

## 【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2024年2月26日提出
【発行者名】	三井住友D Sアセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 猿田 隆
【本店の所在の場所】	東京都港区虎ノ門一丁目17番1号
【事務連絡者氏名】	土屋 裕子
【電話番号】	03-6205-1649
【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】	三井住友D S・T O P I Xインデックス・ファンド 三井住友D S・日経225インデックス・ファンド 三井住友D S・先進国株式インデックス・ファンド 三井住友D S・新興国株式インデックス・ファンド 三井住友D S・先進国債インデックス・ファンド 三井住友D S・新興国債インデックス・ファンド 三井住友D S・国内リートインデックス・ファンド 三井住友D S・先進国リートインデックス・ファンド 三井住友D S・ゴールドインデックス・ファンド（為替ヘッジあり）
【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託受益証券の金額】	三井住友D S・T O P I Xインデックス・ファンド 2兆5,000億円を上限とします。 三井住友D S・日経225インデックス・ファンド 2兆5,000億円を上限とします。 三井住友D S・先進国株式インデックス・ファンド 2兆5,000億円を上限とします。 三井住友D S・新興国株式インデックス・ファンド 2兆5,000億円を上限とします。 三井住友D S・先進国債インデックス・ファンド 2兆5,000億円を上限とします。 三井住友D S・新興国債インデックス・ファンド 2兆5,000億円を上限とします。 三井住友D S・国内リートインデックス・ファンド 2兆5,000億円を上限とします。 三井住友D S・先進国リートインデックス・ファンド 2兆5,000億円を上限とします。 三井住友D S・ゴールドインデックス・ファンド（為替ヘッジあり） 2兆5,000億円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

## 第一部【証券情報】

### （１）【ファンドの名称】

三井住友D S・T O P I Xインデックス・ファンド

三井住友D S・日経225インデックス・ファンド

三井住友D S・先進国株式インデックス・ファンド

三井住友D S・新興国株式インデックス・ファンド

三井住友D S・先進国債インデックス・ファンド

三井住友D S・新興国債インデックス・ファンド

三井住友D S・国内リートインデックス・ファンド

三井住友D S・先進国リートインデックス・ファンド

三井住友D S・ゴールドインデックス・ファンド（為替ヘッジあり）

以下、上記ファンドを総称して、「三井住友D S・ポートフォリオ・シリーズ」または「当ファンド」ということがあり、それぞれを「各ファンド」ということがあります。

また、各ファンドを以下の略称でいうことがあります。

三井住友D S・T O P I Xインデックス・ファンド	: T O P I Xインデックス
三井住友D S・日経225インデックス・ファンド	: 225インデックス
三井住友D S・先進国株式インデックス・ファンド	: 先進国株インデックス
三井住友D S・新興国株式インデックス・ファンド	: 新興国株インデックス
三井住友D S・先進国債インデックス・ファンド	: 先進国債インデックス
三井住友D S・新興国債インデックス・ファンド	: 新興国債インデックス
三井住友D S・国内リートインデックス・ファンド	: Jリートインデックス
三井住友D S・先進国リートインデックス・ファンド	: Gリートインデックス
三井住友D S・ゴールドインデックス・ファンド （為替ヘッジあり）	: ゴールドインデックスヘッジ有

### （２）【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託の受益権です。

\* ファンドの受益権は、社債、株式等の振替に関する法律（以下「社振法」といいます。）の規定の適用を受け、受益権の帰属は、後述の「（11）振替機関に関する事項」に記載の振替機関および当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第2条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、以下「振替機関等」といいます。）の振替口座簿に記載または記録されることにより定まります（以下、振替口座簿に記載または記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。）。委託会社である三井住友D Sアセットマネジメント株式会社は、やむを得ない事情等がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。

当初元本は1口当たり1円です。委託会社の依頼により、信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供された信用格付または信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供される予定の信用格付はありません。

### （３）【発行（売出）価額の総額】

各ファンド2兆5,000億円を上限とします。

### （４）【発行（売出）価格】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額となります。

ただし、累積投資契約に基づく収益分配金の再投資の場合は、各計算期末の基準価額となります。

「基準価額」とは、信託財産の純資産総額を計算日における受益権口数で除した価額をいいます

（基準価額は、便宜上1万口単位で表示される場合があります。）。

基準価額は、組入有価証券の値動き等により日々変動します。

基準価額は、販売会社または委託会社にお問い合わせいただけるほか、原則として翌日付の日本経済新聞朝刊の証券欄「オープン基準価格」の紙面に、以下の通り掲載されます。

ファンド名	掲載名
TOPIXインデックス	SMDTPイ
225インデックス	SMD225イ
先進国株インデックス	SMD先株イ
新興国株インデックス	SMD興株イ
先進国債インデックス	SMD先債イ
新興国債インデックス	SMD興債イ
Jリートインデックス	SMDJリイ
Gリートインデックス	SMDGリイ
ゴールドインデックスヘッジ有	SMD金イH

委託会社に対する照会は下記においてできます。

照会先の名称	コールセンター	ホームページ
三井住友D Sアセットマネジメント株式会社	0120-88-2976	<a href="https://www.smd-am.co.jp">https://www.smd-am.co.jp</a>

お問い合わせは、午前9時～午後5時（土、日、祝・休日を除く）までとさせていただきます。

#### （5）【申込手数料】

原則として、申込金額（取得申込受付日の翌営業日の基準価額×申込口数）に、1.1%（税抜き1.0%）を上限として、販売会社がそれぞれ別に定める申込手数料率を乗じて得た額となります。

累積投資契約に基づく収益分配金の再投資の場合は無手数料となります。

申込手数料に関する詳細は、お申込みの販売会社に問い合わせることにより知ることができます。

#### （6）【申込単位】

お申込単位の詳細は、お申込みの販売会社にお問い合わせください。

#### （7）【申込期間】

2024年2月27日から2024年8月28日まで

申込期間は、上記期間満了前に有価証券届出書を提出することにより更新されます。

#### （8）【申込取扱場所】

販売会社において申込みを取り扱います。

販売会社の詳細につきましては、前記「（4）発行（売出）価格」に記載の委託会社にお問い合わせください。

#### （9）【払込期日】

取得申込者は、申込金額（取得申込受付日の翌営業日の基準価額×申込口数）に申込手数料および当該手数料にかかる消費税等相当額を加算した額を、販売会社の指定の期日までに、指定の方法でお支払いください。

各取得申込みにかかる発行価額の総額は、追加信託が行われる日に、委託会社の指定する口座を経由して、受託会社の指定するファンド口座に払い込まれます。

## ( 1 0 ) 【払込取扱場所】

販売会社において払込みを取り扱います。（販売会社は前記「（４）発行（売出）価格」に記載の委託会社にお問い合わせください。）

## ( 1 1 ) 【振替機関に関する事項】

当ファンドの振替機関は下記の通りです。

株式会社証券保管振替機構

## ( 1 2 ) 【その他】

## イ 申込証拠金

ありません。

## ロ 日本以外の地域における募集

ありません。

## ハ スイッチング

販売会社によっては、「スイッチング」（ある投資信託の換金による手取額をもって、他の投資信託を買い付けること）による当ファンドの取得申込みを取り扱う場合があります。

## ニ お申込不可日

上記にかかわらず、各ファンドにつき、取得申込日が以下のお申込不可日に当たる場合には、ファンドの取得申込みはできません（また、該当日には、解約請求のお申込みもできません。）。

ファンド名	お申込不可日
先進国株インデックス	・ニューヨークの取引所の休業日 ・ロンドンの取引所の休業日
新興国株インデックス	・ニューヨークの取引所の休業日 ・ロンドンの取引所の休業日 ・香港の取引所の休業日
先進国債インデックス	・ニューヨークの銀行の休業日 ・ロンドンの銀行の休業日
新興国債インデックス	・ニューヨークの取引所の休業日 ・ロンドンの取引所の休業日 ・ニューヨークの銀行の休業日 ・ロンドンの銀行の休業日
Gリートインデックス	・ニューヨークの取引所の休業日 ・オーストラリアの取引所の休業日 ・ニューヨークの銀行の休業日
ゴールドインデックスヘッジ有	・ニューヨークの取引所の休業日 ・ニューヨークの銀行の休業日

「TOPIXインデックス」、「225インデックス」、「Jリートインデックス」は、お申込不可日はありません。

## ホ クーリング・オフ制度（金融商品取引法第37条の6）の適用

ありません。

## ヘ 振替受益権について

ファンドの受益権は、社振法の規定の適用を受け、ファンドの振替機関の振替業にかかる業務規程等の規則に従って取り扱われるものとし、ファンドの分配金、償還金、換金代金は、社振法および当該振替機関の業務規程その他の規則に従って支払われます。

(参考：投資信託振替制度)

- ・ファンドの受益権の発生、消滅、移転をコンピュータシステムにて管理するもので、ファンドの設定、解約、償還等がコンピュータシステム上の帳簿(「振替口座簿」といいます。)への記載・記録によって行われます。
- ・受益証券は発行されませんので、盗難や紛失のリスクが削減されます(原則として受益証券を保有することはできません。)
- ・ファンドの設定、解約等における決済リスクが削減されます。
- ・振替口座簿に記録されますので、受益権の所在が明確になります。

## 第二部【ファンド情報】

### 第1【ファンドの状況】

#### 1【ファンドの性格】

##### （1）【ファンドの目的及び基本的性格】

イ 各ファンドは、投資対象とする各マザーファンド受益証券への投資を通じて、実質的に投資対象とする資産へ投資し、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。

各マザーファンドおよびベンチマークについては後述の「2 投資方針」をご参照ください。

ロ 委託会社は、受託会社と合意の上、各ファンド金5,000億円を限度として信託金を追加することができます。この限度額は、委託会社、受託会社の合意により変更できます。

ハ 当ファンドが該当する商品分類、属性区分は次の通りです。

##### （イ）当ファンドが該当する商品分類

三井住友DS・TOPIXインデックス・ファンド

三井住友DS・日経225インデックス・ファンド

項目	該当する商品分類	内容
単位型・追加型	追加型投信	一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいいます。
投資対象地域	国内	目論見書または信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に国内の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
投資対象資産 (収益の源泉)	株式	目論見書または信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
補足分類	インデックス型	目論見書または信託約款において、各種指数の動きに連動する運用成果を目指す旨の記載があるものをいいます。

三井住友DS・先進国株式インデックス・ファンド

三井住友DS・新興国株式インデックス・ファンド

項目	該当する商品分類	内容
単位型・追加型	追加型投信	一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいいます。
投資対象地域	海外	目論見書または信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に海外の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
投資対象資産 (収益の源泉)	株式	目論見書または信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
補足分類	インデックス型	目論見書または信託約款において、各種指数の動きに連動する運用成果を目指す旨の記載があるものをいいます。

三井住友DS・先進国債インデックス・ファンド

三井住友DS・新興国債インデックス・ファンド

項目	該当する商品分類	内容
----	----------	----

単位型・追加型	追加型投信	一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいいます。
投資対象地域	海外	目論見書または信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に海外の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
投資対象資産 (収益の源泉)	債券	目論見書または信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に債券を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
補足分類	インデックス型	目論見書または信託約款において、各種指数の動きに連動する運用成果を目指す旨の記載があるものをいいます。

## 三井住友D S・国内リートインデックス・ファンド

項目	該当する商品分類	内容
単位型・追加型	追加型投信	一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいいます。
投資対象地域	国内	目論見書または信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に国内の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
投資対象資産 (収益の源泉)	不動産投信	目論見書または信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に不動産投資信託の受益証券および不動産投資法人の投資証券を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
補足分類	インデックス型	目論見書または信託約款において、各種指数の動きに連動する運用成果を目指す旨の記載があるものをいいます。

## 三井住友D S・先進国リートインデックス・ファンド

項目	該当する商品分類	内容
単位型・追加型	追加型投信	一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいいます。
投資対象地域	海外	目論見書または信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に海外の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
投資対象資産 (収益の源泉)	不動産投信	目論見書または信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に不動産投資信託の受益証券および不動産投資法人の投資証券を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
補足分類	インデックス型	目論見書または信託約款において、各種指数の動きに連動する運用成果を目指す旨の記載があるものをいいます。

## 三井住友D S・ゴールドインデックス・ファンド(為替ヘッジあり)

項目	該当する商品分類	内容
単位型・追加型	追加型投信	一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいいます。
投資対象地域	内外	目論見書または信託約款において、国内および海外の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいいます。

投資対象資産 (収益の源泉)	その他資産(商品)	目論見書または信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式、債券および不動産投信以外の資産(商品)を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
補足分類	インデックス型	目論見書または信託約款において、各種指数の動きに連動する運用成果を目指す旨の記載があるものをいいます。

## (ロ) 当ファンドが該当する属性区分

## 三井住友DS・TOPIXインデックス・ファンド

項目	該当する属性区分	内容
投資対象資産	その他資産(投資信託証券(株式一般))	目論見書または信託約款において、主として投資信託証券に投資する旨の記載があるものをいいます。「投資信託証券」以下のカッコ内は投資信託証券の先の実質投資対象について記載しています。なお、組み入れる資産そのものは投資信託証券ですが、投資信託証券の先の実質投資対象は株式であり、ファンドの収益は株式市場の動向に左右されるものであるため、商品分類上の投資対象資産(収益の源泉)は「株式」となります。
決算頻度	年1回	目論見書または信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいいます。
投資対象地域	日本	目論見書または信託約款において、組入資産による投資収益が日本の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
投資形態	ファミリーファンド	目論見書または信託約款において、親投資信託(ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除く。)を投資対象として投資するものをいいます。
対象インデックス	TOPIX	目論見書または信託約款において、TOPIX(東証株価指数)の動きに連動する運用成果を目指す旨の記載があるものをいいます。

## 三井住友DS・日経225インデックス・ファンド

項目	該当する属性区分	内容
投資対象資産	その他資産(投資信託証券(株式一般))	目論見書または信託約款において、主として投資信託証券に投資する旨の記載があるものをいいます。「投資信託証券」以下のカッコ内は投資信託証券の先の実質投資対象について記載しています。なお、組み入れる資産そのものは投資信託証券ですが、投資信託証券の先の実質投資対象は株式であり、ファンドの収益は株式市場の動向に左右されるものであるため、商品分類上の投資対象資産(収益の源泉)は「株式」となります。
決算頻度	年1回	目論見書または信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいいます。
投資対象地域	日本	目論見書または信託約款において、組入資産による投資収益が日本の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
投資形態	ファミリーファンド	目論見書または信託約款において、親投資信託(ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除く。)を投資対象として投資するものをいいます。



対象インデックス	日経225	目論見書または信託約款において、日経平均（日経225）の動きに連動する運用成果を目指す旨の記載があるものをいいます。
----------	-------	--

## 三井住友D S ・先進国株式インデックス・ファンド

項目	該当する属性区分	内容
投資対象資産	その他資産（投資信託証券（株式一般））	目論見書または信託約款において、主として投資信託証券に投資する旨の記載があるものをいいます。「投資信託証券」以下のカッコ内は投資信託証券の先の実質投資対象について記載していません。なお、組み入れる資産そのものは投資信託証券ですが、投資信託証券の先の実質投資対象は株式であり、ファンドの収益は株式市場の動向に左右されるものであるため、商品分類上の投資対象資産（収益の源泉）は「株式」となります。
決算頻度	年1回	目論見書または信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいいます。
投資対象地域	グローバル（日本を除く）	目論見書または信託約款において、組入資産による投資収益が日本を除く世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
投資形態	ファミリーファンド	目論見書または信託約款において、親投資信託（ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除く。）を投資対象として投資するものをいいます。
為替ヘッジ	為替ヘッジなし	目論見書または信託約款において、対円での為替のヘッジを行わない旨の記載があるものまたは対円での為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいいます。
対象インデックス	その他の指数（MSCIコクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース））	目論見書または信託約款において、MSCIコクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）の動きに連動する運用成果を目指す旨の記載があるものをいいます。

## 三井住友D S ・新興国株式インデックス・ファンド

項目	該当する属性区分	内容
投資対象資産	その他資産（投資信託証券（資産複合（株式、株価指数先物取引）資産配分変更型））	目論見書または信託約款において、主として投資信託証券に投資する旨の記載があるものをいいます。「投資信託証券」以下のカッコ内は投資信託証券の先の実質投資対象について記載していません。なお、組み入れる資産そのものは投資信託証券ですが、投資信託証券の先の実質投資対象は株式および株価指数先物取引であり、ファンドの収益は株式市場の動向に左右されるものであるため、商品分類上の投資対象資産（収益の源泉）は「株式」となります。
決算頻度	年1回	目論見書または信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいいます。
投資対象地域	エマージング	目論見書または信託約款において、組入資産による投資収益がエマージング地域（新興成長国（地域））の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。

投資形態	ファミリーファンド	目論見書または信託約款において、親投資信託（ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除く。）を投資対象として投資するものをいいます。
為替ヘッジ	為替ヘッジなし	目論見書または信託約款において、対円での為替のヘッジを行わない旨の記載があるものまたは対円での為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいいます。
対象インデックス	その他の指数（MSCIEマーキング・マーケット・インデックス（配当込み、円換算ベース））	目論見書または信託約款において、MSCIEマーキング・マーケット・インデックス（配当込み、円換算ベース）の動きに連動する運用成果を目指す旨の記載があるものをいいます。

## 三井住友DS・先進国債インデックス・ファンド

項目	該当する属性区分	内容
投資対象資産	その他資産（投資信託証券（債券一般））	目論見書または信託約款において、主として投資信託証券に投資する旨の記載があるものをいいます。「投資信託証券」以下のカッコ内は投資信託証券の先の実質投資対象について記載しています。なお、組み入れる資産そのものは投資信託証券ですが、投資信託証券の先の実質投資対象は債券であり、ファンドの収益は債券市場の動向に左右されるものであるため、商品分類上の投資対象資産（収益の源泉）は「債券」となります。
決算頻度	年1回	目論見書または信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいいます。
投資対象地域	グローバル（日本を除く）	目論見書または信託約款において、組入資産による投資収益が日本を除く世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
投資形態	ファミリーファンド	目論見書または信託約款において、親投資信託（ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除く。）を投資対象として投資するものをいいます。
為替ヘッジ	為替ヘッジなし	目論見書または信託約款において、対円での為替のヘッジを行わない旨の記載があるものまたは対円での為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいいます。
対象インデックス	その他の指数（FTSE世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース））	目論見書または信託約款において、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）の動きに連動する運用成果を目指す旨の記載があるものをいいます。

## 三井住友DS・新興国債インデックス・ファンド

項目	該当する属性区分	内容
----	----------	----

投資対象資産	その他資産（投資信託証券（債券一般））	目論見書または信託約款において、主として投資信託証券に投資する旨の記載があるものをいいます。「投資信託証券」以下のカッコ内は投資信託証券の先の実質投資対象について記載していません。なお、組み入れる資産そのものは投資信託証券ですが、投資信託証券の先の実質投資対象は債券であり、ファンドの収益は債券市場の動向に左右されるものであるため、商品分類上の投資対象資産（収益の源泉）は「債券」となります。
決算頻度	年1回	目論見書または信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいいます。
投資対象地域	エマージング	目論見書または信託約款において、組入資産による投資収益がエマージング地域（新興成長国（地域））の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
投資形態	ファミリーファンド	目論見書または信託約款において、親投資信託（ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除く。）を投資対象として投資するものをいいます。
為替ヘッジ	為替ヘッジなし	目論見書または信託約款において、対円での為替のヘッジを行わない旨の記載があるものまたは対円での為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいいます。
対象インデックス	その他の指数（JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（円換算ベース））	目論見書または信託約款において、JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（円換算ベース）の動きに連動する運用成果を目指す旨の記載があるものをいいます。

## 三井住友DS・国内リートインデックス・ファンド

項目	該当する属性区分	内容
投資対象資産	その他資産（投資信託証券（不動産投信））	目論見書または信託約款において、主として投資信託証券に投資する旨の記載があるものをいいます。「投資信託証券」以下のカッコ内は投資信託証券の先の実質投資対象について記載していません。なお、組み入れる資産そのものは投資信託証券ですが、投資信託証券の先の実質投資対象は不動産投信であり、ファンドの収益は不動産投信市場の動向に左右されるものであるため、商品分類上の投資対象資産（収益の源泉）は「不動産投信」となります。
決算頻度	年1回	目論見書または信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいいます。
投資対象地域	日本	目論見書または信託約款において、組入資産による投資収益が日本の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
投資形態	ファミリーファンド	目論見書または信託約款において、親投資信託（ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除く。）を投資対象として投資するものをいいます。

対象インデックス	その他の指数（東証REIT指数（配当込み））	目論見書または信託約款において、東証REIT指数（配当込み）の動きに連動する運用成果を目指す旨の記載があるものをいいます。
----------	------------------------	---

## 三井住友DS・先進国リートインデックス・ファンド

項目	該当する属性区分	内容
投資対象資産	その他資産（投資信託証券（不動産投信））	目論見書または信託約款において、主として投資信託証券に投資する旨の記載があるものをいいます。「投資信託証券」以下のカッコ内は投資信託証券の先の実質投資対象について記載しています。なお、組み入れる資産そのものは投資信託証券ですが、投資信託証券の先の実質投資対象は不動産投信であり、ファンドの収益は不動産投信市場の動向に左右されるものであるため、商品分類上の投資対象資産（収益の源泉）は「不動産投信」となります。
決算頻度	年1回	目論見書または信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいいます。
投資対象地域	グローバル（日本を除く）	目論見書または信託約款において、組入資産による投資収益が日本を除く世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
投資形態	ファミリーファンド	目論見書または信託約款において、親投資信託（ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除く。）を投資対象として投資するものをいいます。
為替ヘッジ	為替ヘッジなし	目論見書または信託約款において、対円での為替のヘッジを行わない旨の記載があるものまたは対円での為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいいます。
対象インデックス	その他の指数（S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース））	目論見書または信託約款において、S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）の動きに連動する運用成果を目指す旨の記載があるものをいいます。

## 三井住友DS・ゴールドインデックス・ファンド（為替ヘッジあり）

項目	該当する属性区分	内容
投資対象資産	その他資産（投資信託証券（商品））	目論見書または信託約款において、主として投資信託証券に投資する旨の記載があるものをいいます。「投資信託証券」以下のカッコ内は投資信託証券の先の実質投資対象について記載しています。なお、組み入れる資産そのものは投資信託証券ですが、投資信託証券の先の実質投資対象は金地金価格との連動を目指す上場投資信託証券であり、ファンドの収益は金市場（商品市場）の動向に左右されるものであるため、商品分類上の投資対象資産（収益の源泉）は「商品」となります。
決算頻度	年1回	目論見書または信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいいます。
投資対象地域	グローバル（日本を含む）	目論見書または信託約款において、組入資産による投資収益が日本を含む世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。

投資形態	ファミリーファンド	目論見書または信託約款において、親投資信託（ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除く。）を投資対象として投資するものをいいます。
為替ヘッジ	為替ヘッジあり（フルヘッジ）	目論見書または信託約款において、対円での為替のフルヘッジを行う旨の記載があるものをいいます。
対象インデックス	その他の指数（L B M A金価格（円ヘッジ換算ベース））	目論見書または信託約款において、L B M A金価格（円ヘッジ換算ベース）の動きに連動する運用成果を目指す旨の記載があるものをいいます。

## 商品分類表

三井住友DS・TOPIXインデックス・ファンド

三井住友DS・日経225インデックス・ファンド

単位型・追加型	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)	補足分類
単位型  追加型	国内	株式 債券	インデックス型
	海外	不動産投信	特殊型
	内外	その他資産 ( ) 資産複合	

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

三井住友DS・先進国株式インデックス・ファンド

三井住友DS・新興国株式インデックス・ファンド

単位型・追加型	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)	補足分類
単位型  追加型	国内	株式 債券	インデックス型
	海外	不動産投信	特殊型
	内外	その他資産 ( ) 資産複合	

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

三井住友DS・先進国債インデックス・ファンド

三井住友DS・新興国債インデックス・ファンド

単位型・追加型	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)	補足分類
---------	--------	-------------------	------

単位型  追加型	国内	株式 債券	インデックス型
	海外	不動産投信	特殊型
	内外	その他資産 ( ) 資産複合	

（注）当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

#### 三井住友D S ・国内リートインデックス・ファンド

単位型・追加型	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)	補足分類
単位型  追加型	国内	株式 債券	インデックス型
	海外	不動産投信	特殊型
	内外	その他資産 ( ) 資産複合	

（注）当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

#### 三井住友D S ・先進国リートインデックス・ファンド

単位型・追加型	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)	補足分類
単位型  追加型	国内	株式 債券	インデックス型
	海外	不動産投信	特殊型
	内外	その他資産 ( ) 資産複合	

（注）当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

#### 三井住友D S ・ゴールドインデックス・ファンド（為替ヘッジあり）

単位型・追加型	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)	補足分類

単位型	国内	株式	インデックス型
		債券	
	海外	不動産投信	
追加型		その他資産	特殊型
	内外	(商品) 資産複合	

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

### 属性区分表

#### 三井住友DS・TOPIXインデックス・ファンド

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	対象インデックス
株式 一般 大型株 中小型株	年1回	グローバル	ファミリーファンド	日経225
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 ( )	年2回	日本		
	年4回	北米		
	年6回(隔月)	欧州		
不動産投信	年12回(毎月)	アジア	ファンド・オブ・ファンズ	TOPIX
その他資産 (投資信託証券 (株式 一般))	日々	オセアニア		
資産複合 ( ) 資産配分固定型 資産配分変更型	その他 ( )	中南米		
		アフリカ		
		中近東(中東)		
		エマージング		その他 ( )

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

#### 三井住友DS・日経225インデックス・ファンド

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	対象インデックス
株式 一般 大型株 中小型株	年1回	グローバル	ファミリーファンド	日経225
債券 一般	年2回	日本		
	年4回	北米		
	年6回(隔月)	欧州		

公債 社債 その他債券 クレジット属性 ( )	年12回(毎月)	アジア		
	日々	オセアニア		TOPIX
不動産投信	その他 ( )	中南米	ファンド・オブ・ファンズ	
		アフリカ		
その他資産 (投資信託証券 (株式一般))		中近東(中東)		その他 ( )
資産複合 ( )		エマージング		
資産配分固定型 資産配分変更型				

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

### 三井住友DS・先進国株式インデックス・ファンド

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ	対象インデックス
株式	年1回	グローバル (日本を除く)			
一般 大型株 中小型株	年2回	日本			日経225
	年4回	北米			
債券			ファミリーファンド	あり	
一般	年6回(隔月)	欧州			
公債					
社債	年12回(毎月)	アジア			
その他債券 クレジット属 性 ( )	日々	オセアニア			TOPIX
	その他	中南米			
不動産投信	( )	アフリカ	ファンド・オブ・ ファンズ	なし	
その他資産 (投資信託証券 (株式一般))		中近東(中東)			その他 (MSCIコクサイ・イ ンデックス(配当込 み、円換算ペー ス))
資産複合 ( )		エマージング			
資産配分固 定型					
資産配分変 更型					



(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

## 三井住友D S・新興国株式インデックス・ファンド

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ	対象インデックス
株式 一般 大型株 中小型株	年1回	グローバル			日経225
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 ( )	年2回 年4回 年6回(隔月) 年12回(毎月) 日々 その他 ( )	日本 北米 欧州 アジア オセアニア 中南米 アフリカ	ファミリーファンド      ファンド・オブ・ファンズ	あり      なし	TOPIX
その他資産 (投資信託証券 (資産複合(株式、株 価指数先物取引)資産配 分変更型))		中近東(中東)			その他 (MSCIエマージング・ マーケット・イン デックス(配当込 み、円換算ベー ス))
資産複合 ( ) 資産配分固 定型 資産配分変 更型		エマージング			

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

## 三井住友D S・先進国債インデックス・ファンド

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ	対象インデックス
株式 一般 大型株 中小型株	年1回	グローバル (日本を除く)			日経225
債券 一般	年2回 年4回 年6回(隔月)	日本 北米 欧州	ファミリーファンド	あり	

公債 社債 その他債券 クレジット属 性 ( )	年12回(毎月)	アジア			
	日々	オセアニア			TOPIX
	その他 ( )	中南米			
不動産投信			ファンド・オブ・ ファンズ	なし	
その他資産 (投資信託証券 (債券 一般))		アフリカ			
					その他 (FTSE世界国債イ ンデックス(除く日 本、円換算ベー ス))
資産複合 ( ) 資産配分固 定型 資産配分変 更型		中近東(中東)			
		エマージング			

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

#### 三井住友DS・新興国債インデックス・ファンド

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ	対象インデックス
株式 一般 大型株 中小型株	年1回	グローバル			
	年2回	日本			日経225
	年4回	北米			
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属 性 ( )	年6回(隔月)	欧州	ファミリーファンド	あり	
	年12回(毎月)	アジア			
	日々	オセアニア			TOPIX
	その他 ( )	中南米			
不動産投信			ファンド・オブ・ ファンズ	なし	
		アフリカ			
その他資産 (投資信託証券 (債券 一般))					

資産複合 ( ) 資産配分固 定型 資産配分変 更型		中近東(中東)  エマージング		その他 (JPモルガン・エ マージング・マー ケット・ボンド・イン デックス・プラス(円 換算ベース))
---	--	-----------------------	--	---

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

### 三井住友DS・国内リートインデックス・ファンド

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	対象インデックス
株式 一般 大型株 中小型株	年1回	グローバル		
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 ( )	年2回 年4回 年6回(隔月) 年12回(毎月) 日々	日本 北米 欧州 アジア オセアニア	ファミリーファンド	日経225    TOPIX
不動産投信  その他資産 (投資信託証券 (不動産投信))	その他 ( )	中南米 アフリカ	ファンド・オブ・ファンズ	
資産複合 ( ) 資産配分固定型 資産配分変更型		中近東(中東)  エマージング		その他 (東証REIT指数(配当込 み))

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

### 三井住友DS・先進国リートインデックス・ファンド

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ	対象インデックス
株式 一般	年1回	グローバル (日本を除く)			

大型株 中小型株	年2回	日本			日経225
	年4回	北米			
債券			ファミリーファンド	あり	
一般	年6回(隔月)	欧州			
公債					
社債	年12回(毎月)	アジア			
その他債券					
クレジット属性	日々	オセアニア			TOPIX
( )					
不動産投信	その他	中南米	ファンド・オブ・ファンズ	なし	
	( )	アフリカ			
その他資産					
(投資信託証券					
(不動産投信))					
		中近東(中東)			その他
					(S&P先進国REI
					T指数(除く日本、
					配当込み、円換算
					ベース))
資産複合		エマージング			
( )					
資産配分固					
定型					
資産配分変					
更型					

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

三井住友DS・ゴールドインデックス・ファンド(為替ヘッジあり)

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ	対象インデックス
株式	年1回	グローバル (日本を含む)			
一般	年2回	日本			日経225
大型株	年4回	北米			
中小型株					
債券			ファミリーファンド	あり (フルヘッジ)	
一般	年6回(隔月)	欧州			
公債					
社債	年12回(毎月)	アジア			
その他債券					
クレジット属性	日々	オセアニア			TOPIX
( )					
不動産投信	その他	中南米	ファンド・オブ・ファンズ	なし	
	( )	アフリカ			

その他資産 (投資信託証券 (商品))						その他 (LBMA金価格 (円ヘッジ換算ペー ス))
資産複合 ( ) 資産配分固 定型 資産配分変 更型		中近東(中東)  エマージング				

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

属性区分の「為替ヘッジ」は、対円での為替変動リスクに対するヘッジの有無を記載しています。商品分類、属性区分は、一般社団法人投資信託協会「商品分類に関する指針」に基づき記載していません。商品分類、属性区分の全体的な定義等は一般社団法人投資信託協会のホームページ (<https://www.toushin.or.jp/>) をご覧ください。

## (2) 【ファンドの沿革】

2021年8月23日 信託契約締結、設定、運用開始

## (3) 【ファンドの仕組み】

イ 当ファンドの関係法人とその役割

(イ) 委託会社 「三井住友D Sアセットマネジメント株式会社」

証券投資信託契約に基づき、信託財産の運用指図、投資信託説明書（目論見書）および運用報告書の作成等を行います。

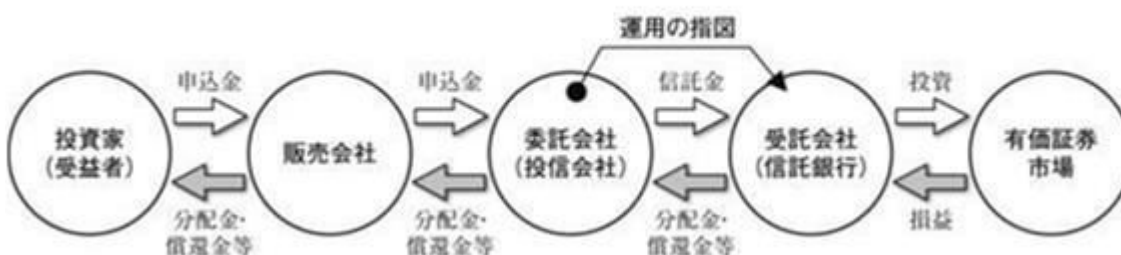
(ロ) 受託会社 「三井住友信託銀行株式会社」

証券投資信託契約に基づき、信託財産の保管・管理・計算等を行います。なお、信託事務の一部につき、株式会社日本カストディ銀行に委託することがあります。また、外国における資産の保管は、その業務を行うに十分な能力を有すると認められる外国の金融機関が行う場合があります。

(ハ) 販売会社

委託会社との間で締結される販売契約（名称の如何を問いません。）に基づき、当ファンドの募集・販売の取扱い、投資信託説明書（目論見書）の提供、受益者からの一部解約実行請求の受付、受益者への収益分配金、一部解約金および償還金の支払事務等を行います。

### 運営の仕組み



## □ 委託会社の概況

### （イ）資本金の額

20億円（2023年12月29日現在）

### （ロ）会社の沿革

1985年7月15日	三生投資顧問株式会社設立
1987年2月20日	証券投資顧問業の登録
1987年6月10日	投資一任契約にかかる業務の認可
1999年1月1日	三井生命保険相互会社の特別勘定運用部門と統合
1999年2月5日	三生投資顧問株式会社から三井生命グローバルアセットマネジメント株式会社へ商号変更
2000年1月27日	証券投資信託委託業の認可取得
2002年12月1日	住友ライフ・インベストメント株式会社、スミセイ グローバル投信株式会社、三井住友海上アセットマネジメント株式会社およびさくら投信投資顧問株式会社と合併し、三井住友アセットマネジメント株式会社に商号変更
2013年4月1日	トヨタアセットマネジメント株式会社と合併
2019年4月1日	大和住銀投信投資顧問株式会社と合併し、三井住友D S アセットマネジメント株式会社に商号変更

### （ハ）大株主の状況

（2023年12月29日現在）

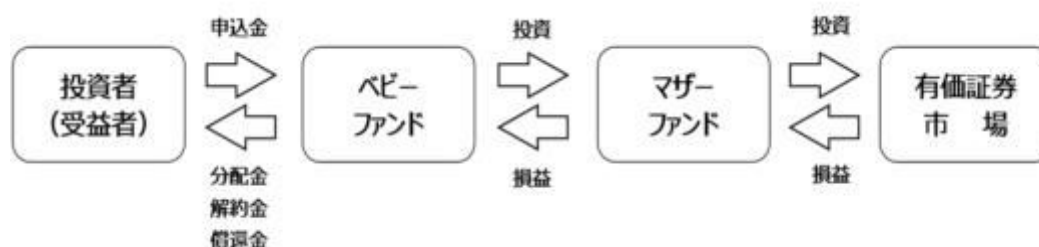
名称	住所	所有株式数 (株)	比率 (%)
株式会社三井住友フィナンシャルグループ	東京都千代田区丸の内一丁目1番2号	16,977,897	50.1
株式会社大和証券グループ本社	東京都千代田区丸の内一丁目9番1号	7,946,406	23.5
三井住友海上火災保険株式会社	東京都千代田区神田駿河台三丁目9番地	5,080,509	15.0
住友生命保険相互会社	大阪府大阪市中央区城見一丁目4番35号	3,528,000	10.4
三井住友信託銀行株式会社	東京都千代田区丸の内一丁目4番1号	337,248	1.0

## 八 ファンドの運用形態

各ファンド（三井住友D S・ゴールドインデックス・ファンド（為替ヘッジあり）を除く）

（ファミリーファンド方式による運用）

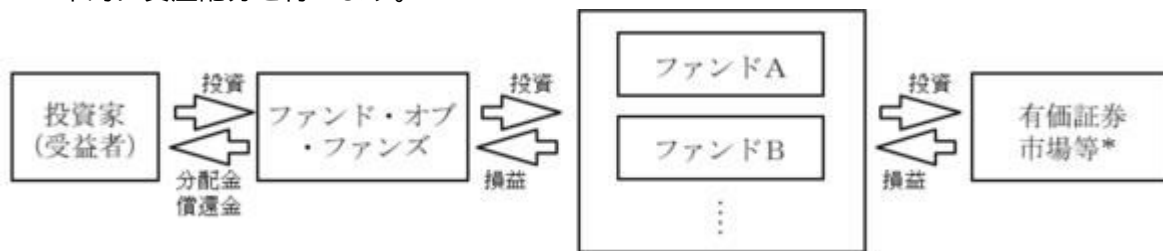
「ファミリーファンド方式」とは、複数のファンドを合同運用する仕組みで、受益者の資金をまとめて「ベビーファンド」とし、「ベビーファンド」の資金の全部または一部を「マザーファンド」に投資することにより、実質的な運用は「マザーファンド」において行う仕組みです。



三井住友D S・ゴールドインデックス・ファンド（為替ヘッジあり）

（ファンド・オブ・ファンズによる運用）

一般に、「ファンド・オブ・ファンズ」においては、株式や債券などの有価証券に直接投資するのではなく、複数の他の投資信託（ファンド）を組み入れることにより運用を行います（投資信託に投資する投資信託）。また、種々の特長を持った投資信託を購入することにより、効率的に資産配分を行います。



\*当ファンドにおいては金現物を含みます。

なお、当ファンドは、「ファミリーファンド方式」を採用しており、実際の他のファンドへの投資は、マザーファンドを通じて行います。

## 2【投資方針】

### （1）【投資方針】

#### イ 基本方針

各ファンドは、投資対象とする各マザーファンド受益証券への投資を通じて、実質的に投資対象とする資産へ投資し、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。

#### ロ 投資態度

三井住友DS・TOPIXインデックス・ファンド

- （イ）国内株式インデックス・マザーファンド（B号）への投資を通じて、主としてTOPIX（東証株価指数）に採用されている銘柄の株式に投資することにより、TOPIX（東証株価指数、配当込み）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。
- （ロ）株式以外の資産（他の投資信託受益証券を通じて投資する場合は、当該他の投資信託の信託財産に属する株式以外の資産のうち、この投資信託の信託財産に属するとみなした部分を含みます。）への投資割合は、原則として信託財産総額の50%以下とします。
- （ハ）株価指数先物取引等を含む株式の実質組入比率は、原則として高位を保ちます。
- （二）国内株式インデックス・マザーファンド（B号）の組入比率は、原則として高位を保ちます。
- （ホ）資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。
- （ヘ）デリバティブ取引（法人税法第61条の5で定めるものをいいます。）は、信託財産の資産または負債にかかる価格変動および金利変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。

三井住友DS・日経225インデックス・ファンド

- （イ）225マザーファンド受益証券への投資を通じて、実質的に日本の株式に投資し、日経平均株価（日経225）の動きに連動する投資成果を目指した運用を行います。
- （ロ）225マザーファンド受益証券の組入比率は、原則として高位を保ちます。
- （ハ）運用の効率化を図るため、株価指数先物取引等を活用する場合があります。
- （二）株式の実質投資比率は、原則として、純資産総額の+110%以内とします。
- （ホ）株式以外の資産（他の投資信託受益証券を通じて投資する場合は、当該他の投資信託の信託財産に属する株式以外の資産のうち、この投資信託の信託財産に属するとみなした部分を含みます。）への投資割合は、原則として信託財産総額の50%以下とします。
- （ヘ）資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。
- （ト）デリバティブ取引（法人税法第61条の5で定めるものをいいます。）は、信託財産の資産または負債にかかる価格変動および金利変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の

対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。

#### 三井住友D S ・先進国株式インデックス・ファンド

- (イ) 外国株式インデックス・マザーファンドへの投資を通じて、主として日本を除く世界各国の株式に投資することにより、MSCIコクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。
- (ロ) 株価指数先物取引等を含む株式の実質組入比率は、原則として高位を保ちます。
- (ハ) 外国株式インデックス・マザーファンドの組入比率は、原則として高位を保ちます。
- (ニ) 実質組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行いません。
- (ホ) 資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。
- (ヘ) デリバティブ取引（法人税法第61条の5で定めるものをいいます。）は、信託財産の資産または負債にかかる価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。
- (ト) 外国為替予約取引は、信託財産の資産または負債にかかる為替変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。

#### 三井住友D S ・新興国株式インデックス・ファンド

- (イ) エマージング株式インデックス・マザーファンドへの投資を通じて、主として新興国の株式（預託証書（DR）、株式の値動きに連動する有価証券を含みます。）、新興国の株価指数を対象とした先物取引および新興国の株式等を主要投資対象とする上場投資信託証券に投資することにより、MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。なお、運用にあたっては、ファンドの資産規模、市況動向に応じて株式、株価指数先物取引、上場投資信託証券、短期公社債等および為替取引を組み合わせて運用を行います。
- (ロ) エマージング株式インデックス・マザーファンドの組入比率は、原則として高位を保ちます。
- (ハ) 実質組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行いません。
- (ニ) 資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。
- (ホ) デリバティブ取引（法人税法第61条の5で定めるものをいいます。）は、信託財産の資産または負債にかかる価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。
- (ヘ) 外国為替予約取引は、信託財産の資産または負債にかかる為替変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。

#### 三井住友D S ・先進国債インデックス・ファンド

- (イ) 外国債券パッシブ・マザーファンドへの投資を通じて、主として外国の国債に投資することにより、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。
- (ロ) 外国債券パッシブ・マザーファンドの組入比率は、原則として高位を保ちます。
- (ハ) 実質組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行いません。
- (ニ) 資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。
- (ホ) デリバティブ取引（法人税法第61条の5で定めるものをいいます。）は、信託財産の資産または負債にかかる価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。
- (ヘ) 外国為替予約取引は、信託財産の資産または負債にかかる為替変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。



## 三井住友D S ・新興国債インデックス・ファンド

- (イ) 米ドル建て新興国債インデックス・マザーファンドへの投資を通じて、主として米ドル建ての新興国の公社債に投資することにより、J P モルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。ただし、運用の効率性を勘案し、流動性の高い国、銘柄を中心に投資します。
- (ロ) 米ドル建て新興国債インデックス・マザーファンドの組入比率は、原則として高位を保ちます。
- (ハ) 実質組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行いません。
- (ニ) 資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。
- (ホ) デリバティブ取引（法人税法第61条の5で定めるものをいいます。）は、信託財産の資産または負債にかかる価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。
- (ヘ) 外国為替予約取引は、信託財産の資産または負債にかかる為替変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。

## 三井住友D S ・国内リートインデックス・ファンド

- (イ) J リート・インデックス・マザーファンドへの投資を通じて、実質的に以下の運用を行います。
- ・主として日本の取引所に上場（上場予定を含みます。）している不動産投資信託（R E I T）に投資することにより、東証R E I T 指数（配当込み）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。
  - ・不動産投資信託（R E I T）への投資にあたっては、東証R E I T 指数採用銘柄（採用予定を含みます。）に投資を行うものとします。
  - ・ベンチマークとの連動を維持するため、不動産投信指数先物取引等を活用する場合があります。このため、不動産投資信託（R E I T）の実質組入時価総額と不動産投信指数先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が純資産総額を超えることがあります。
- (ロ) J リート・インデックス・マザーファンドの組入比率は、原則として高位を保ちます。
- (ハ) 資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。
- (ニ) デリバティブ取引（法人税法第61条の5で定めるものをいいます。）は、信託財産の資産または負債にかかる価格変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。

## 三井住友D S ・先進国リートインデックス・ファンド

- (イ) 外国リート・インデックス・マザーファンドへの投資を通じて、実質的に以下の運用を行います。
- ・日本を除く世界各国の不動産投資信託（R E I T）等に投資することにより、S & P 先進国R E I T 指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。
  - ・不動産投資信託（R E I T）等への投資にあたっては、S & P 先進国R E I T 指数（除く日本）採用銘柄（採用予定を含みます。）に投資を行うものとします。
- (ロ) 外国リート・インデックス・マザーファンドの組入比率は、原則として高位を保ちます。
- (ハ) 実質組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行いません。
- (ニ) 資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。
- (ホ) デリバティブ取引（法人税法第61条の5で定めるものをいいます。）は、信託財産の資産または負債にかかる価格変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。
- (ヘ) 外国為替予約取引は、信託財産の資産または負債にかかる為替変動により生じるリスクを減

じる目的以外には利用しません。

三井住友DS・ゴールドインデックス・ファンド（為替ヘッジあり）

- (イ) ゴールド・インデックス・マザーファンドへの投資を通じて、主として、金地金価格との連動を目指す投資信託証券に投資し、実質組入外貨建資産について原則として対円での為替ヘッジを行うことにより、ロンドン貴金属市場協会（LBMA）金価格（円ヘッジ換算ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。
- (ロ) ゴールド・インデックス・マザーファンドが主要投資対象とする投資信託証券は、継続的にモニタリングを行い、商品性及び運用上の効率性を損なわない範囲で、委託会社の判断により見直しを行うことがあります。
- (ハ) ゴールド・インデックス・マザーファンドの組入比率は、原則として高位を保ちます。
- (ニ) 実質組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを活用し、為替変動リスクの低減を図ります。
- (ホ) 資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。
- (ヘ) 外国為替予約取引は、信託財産の資産または負債にかかる為替変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。

## ファンドの特色

1

「三井住友DS・ポートフォリオ・シリーズ」は、複数ファンドで構成されており、各ファンドは投資対象とする各マザーファンドへの投資を通じて、実質的に投資対象とする資産に投資します。

※各マザーファンドおよび投資対象とする資産については後掲の「ファンドのしくみ」をご参照ください。

2

各ファンドは、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指します。

ファンド名	ベンチマーク
TOPIXインデックス	TOPIX(東証株価指数、配当込み)
225インデックス	日経平均株価(日経225)
先進国株インデックス	MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円換算ベース)
新興国株インデックス	MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円換算ベース)
先進国債インデックス	FTSE世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース)
新興国債インデックス	JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス(円換算ベース)
Jリートインデックス	東証REIT指数(配当込み)
Gリートインデックス	S&P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、円換算ベース)
ゴールドインデックス ヘッジ有	LBMA金価格(円ヘッジ換算ベース)

3

「三井住友DS・ポートフォリオ・シリーズ」の各ファンド間でのスイッチングが可能です。

- 一部のファンドのみの取扱いとなる場合があります。また、スイッチングが行えない場合があります。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

※資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

## ファンドのしくみ

■ファミリーファンド方式を採用し、マザーファンドの組入れを通じて、実際の運用を行います。

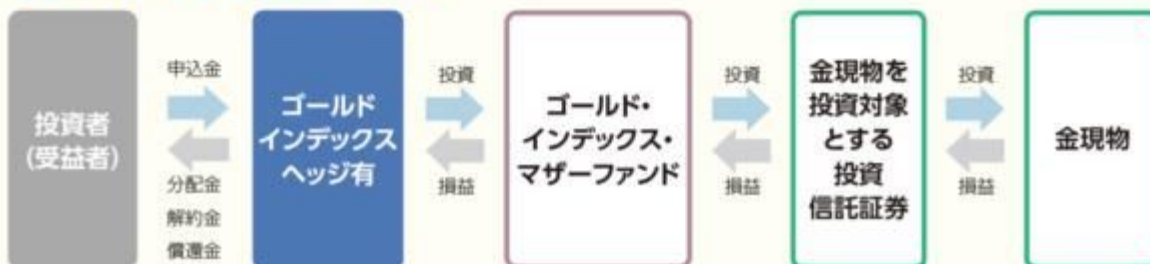
### ▶各ファンド(ゴールドインデックスヘッジ有を除く)



※上記における各ファンド、各マザーファンドおよび各投資対象資産は以下のとおりになります。

ファンド	マザーファンド	投資対象資産
TOPIXインデックス	国内株式インデックス・マザーファンド(B号)	日本の株式等
225インデックス	225マザーファンド	
先進国株インデックス	外国株式インデックス・マザーファンド	日本を除く 世界各国・地域の株式等
新興国株インデックス	エマージング株式インデックス・マザーファンド	新興国の株式および 株式指数先物取引等
先進国債インデックス	外国債券パッシブ・マザーファンド	日本を除く 世界各国・地域の公社債等
新興国債インデックス	米ドル建て新興国債インデックス・マザーファンド	新興国の公社債等
Jリートインデックス	Jリート・インデックス・マザーファンド	日本のリート等
Gリートインデックス	外国リート・インデックス・マザーファンド	日本を除く 世界各国・地域のリート等

### ▶ゴールドインデックスヘッジ有



## 各ファンドの運用の基本方針等

## ▶ 国内株式

## TOPIXインデックス

ベンチマーク TOPIX(東証株価指数、配当込み)

運用の基本方針 ● マザーファンドへの投資を通じて、主としてTOPIX(東証株価指数)に採用されている銘柄の株式に投資し、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指します。  
※株価指数先物取引等を利用することがあります。

## 225インデックス

ベンチマーク 日経平均株価(日経225)

運用の基本方針 ● マザーファンドへの投資を通じて、日本の取引所に上場している株式等に投資し、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指します。

## ▶ 先進国株式

## 先進国株インデックス

ベンチマーク MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円換算ベース)

運用の基本方針 ● マザーファンドへの投資を通じて、主として日本を除く世界各国・地域の株式等に投資し、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指します。  
※株価指数先物取引等を利用することがあります。  
● 実質組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行いません。  
※基準価額は為替変動の影響を受けます。

## ▶ 新興国株式

## 新興国株インデックス

ベンチマーク MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円換算ベース)

運用の基本方針 ● マザーファンドへの投資を通じて、主として新興国の株式\*、新興国の株式指数を対象とした先物取引および新興国の株式等を対象とする上場投資信託証券(ETF)に投資し、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指します。  
\*預託証書(DR)、株式の値動きに連動する有価証券を含みます。  
※ファンドの資産規模、市況動向に応じて株式、株価指数先物取引、上場投資信託証券(ETF)、短期公社債等および為替取引を組み合わせて運用を行います。  
● 実質組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行いません。  
※基準価額は為替変動の影響を受けます。



預託証書(DR)とは

Depository Receiptの略で、株式を海外で流通させるために、その株式を銀行などに預託し、その代替として海外で発行される証券をいい、株式と同様に取引所などで取引されます。

## ▶ 先進国債券

## 先進国債インデックス

ベンチマーク FTSE世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース)

## 運用の基本方針

- マザーファンドへの投資を通じて、主として外国の国債に投資し、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指します。
- 実質組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行いません。  
※基準価額は為替変動の影響を受けます。

## ▶ 新興国債券

## 新興国債インデックス

ベンチマーク JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス(円換算ベース)

## 運用の基本方針

- マザーファンドへの投資を通じて、主として米ドル建ての新興国の公社債に投資し、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指します。  
※運用の効率性を勘案し、流動性の高い国、銘柄を中心に投資します。
- 実質組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行いません。  
※基準価額は為替変動の影響を受けます。

## ▶ 国内リート

## Jリートインデックス

ベンチマーク 東証REIT指数(配当込み)

## 運用の基本方針

- マザーファンドへの投資を通じて、主として日本の取引所に上場している不動産投資信託(リート)に投資し、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指します。  
※不動産投信指数先物取引等を利用することがあります。

## ▶ 外国リート

## Gリートインデックス

ベンチマーク S&amp;P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、円換算ベース)

## 運用の基本方針

- マザーファンドへの投資を通じて、主として日本を除く世界各国・地域の取引所に上場している不動産投資信託(リート)に投資し、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指します。
- 実質組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行いません。  
※基準価額は為替変動の影響を受けます。

## ▶ 金

## ゴールドインデックスヘッジ有

ベンチマーク	LBMA金価格(円ヘッジ換算ベース)
運用の基本方針	<ul style="list-style-type: none"> <li>● マザーファンドへの投資を通じて、金地金価格との連動を目指す投資信託証券*に投資し、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指します。</li> <li>※ マザーファンドが投資対象とする投資信託証券は、継続的にモニタリングを行い、商品性および運用上の効率性を損なわない範囲で、委託会社の判断により見直しを行うことがあります。</li> <li>※ 実質的な投資対象とする投資信託証券は、以下の通りです。 [iShares Gold Trust] [SPDR Gold MiniShares Trust] ただし、一部の投資信託証券のみの投資となる場合があります。</li> <li>● 実質組入外貨建資産については、原則として対円で為替ヘッジを行い、為替変動リスクの低減を図ります。</li> <li>※ 完全に為替変動リスクを回避することはできません。</li> </ul>

## ■ ゴールド・インデックス・マザーファンドが投資対象とする投資信託証券の概要

以下は、2023年12月末現在で知り得る情報に基づくものであり、今後、変更される場合があります。

ファンド名	iShares Gold Trust (iシェアーズ ゴールド・トラスト)	SPDR Gold MiniShares Trust (SPDR* ゴールド・ミニシェアーズ・トラスト)
形態	米国籍上場投資信託(米ドル建て)	米国籍上場投資信託(米ドル建て)
管理会社	iShares デラウェア・トラスト・スポンサー・ エルエルシー	WGC USAアセット・マネジメント・カンパニー・ エルエルシー
運用の基本方針	金地金価格の変動に概ね連動することを目標とします。	金地金の価格のパフォーマンスを反映させることを目標とします。
ベンチマーク	LBMA金価格	LBMA金価格
管理費用*1	年0.25%	年0.10%
購入の可否*2	日本において一般投資者の購入が可能です。	日本において一般投資者の購入が可能です。

\*1 管理費用とは各上場投資信託(以下「ETF」といいます。)の運用管理費用およびその他費用を各ETFの平均純資産総額で除したもので、本書の数値は各ETFの直近の目論見書等で開示されているものです。

\*2 外国籍のETFは、海外の上場有価証券を取り次ぐことのできる証券会社を通じて、日本国内の一般の投資者が、直接、購入することができるものがあります。直接購入される際は、売買委託手数料(証券会社ごとに異なります。)がかかります。また、円貨と外貨を交換する際に、証券会社が別途定める手数料がかかります。

## 為替の影響について

## ▶ 為替ヘッジあり

為替ヘッジあり\*

為替変動の影響は限定的

\*為替ヘッジコストがかかります。

■外貨建資産に対し、対円での為替ヘッジを行う場合、基準価額への為替変動の影響は小さくなると考えられます。ただし、完全に為替変動リスクを回避することはできません。



為替ヘッジ

為替取引等を利用し、為替変動リスクを低減することです。

## ▶ 為替ヘッジなし

為替ヘッジなし

円安の場合(為替差益)  
基準価額にプラス円高の場合(為替差損)  
基準価額にマイナス

■外貨建資産に対し、対円での為替ヘッジを行わない場合、基準価額は為替変動の影響を受けます。

## 各ファンドの運用プロセス



\*ユニバースの決定を行わないファンドもあります。

## [ポートフォリオの構築手法]

構築手法	ファンド名
最適化法	TOPIXインデックス、先進国株インデックス、新興国株インデックス
層化抽出法	先進国債インデックス、新興国債インデックス
完全法	225インデックス、Jリートインデックス、Gリートインデックス



## 最適化法とは

計量モデル等に基づいて、インデックスとの連動性を保てるように、インデックス構成銘柄の一部を抽出してポートフォリオを構築する方法です。

## 層化抽出法とは

指数を構成する銘柄をいくつかのグループ(層)に分け、それぞれのグループから代表銘柄を抽出して構成銘柄を選択し、ポートフォリオを構築する方法です。

## 完全法とは

指数を構成するすべての銘柄について、その時価構成比率に合わせて保有し、ポートフォリオを構築する方法です。

※上記の運用プロセスは今後変更される場合があります。

※ゴールドインデックスヘッジ有については、金現物に投資する投資信託証券への投資により、インデックスの動きへの連動を目指した運用を行います。



## 追加的記載事項

### ●各ファンドがベンチマークとする指数の著作権等について

#### <TOPIXインデックス、Jリートインデックス>

- TOPIX、東証REIT指数の指数値およびTOPIX、東証REIT指数にかかる標章または商標は、株式会社JPX総研または株式会社JPX総研の関連会社(以下「JPX」といいます。)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用などTOPIX、東証REIT指数に関するすべての権利・ノウハウおよびTOPIX、東証REIT指数にかかる標章または商標に関するすべての権利はJPXが有します。
- JPXは、TOPIX、東証REIT指数の指数値の算出もしくは公表の方法の変更、TOPIX、東証REIT指数の指数値の算出もしくは公表の停止またはTOPIX、東証REIT指数にかかる標章もしくは商標の変更もしくは使用の停止を行うことができます。
- JPXは、TOPIX、東証REIT指数の指数値およびTOPIX、東証REIT指数にかかる標章または商標の使用に関して得られる結果ならびに特定日のTOPIX、東証REIT指数の指数値について、何ら保証、言及をするものではありません。
- JPXは、TOPIX、東証REIT指数の指数値およびそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また、JPXは、TOPIX、東証REIT指数の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。
- 当ファンドは、JPXにより提供、保証または販売されるものではありません。
- JPXは、当ファンドの購入者または公衆に対し、当ファンドの説明または投資のアドバイスをする義務を負いません。
- JPXは、委託会社または当ファンドの購入者のニーズを、TOPIX、東証REIT指数の指数値を算出する銘柄構成および計算に考慮するものではありません。
- 以上の項目に限らず、JPXは当ファンドの設定、販売および販売促進活動に起因するいかなる損害に対しても責任を有しません。

#### <225インデックス>

- 日経平均株価は、株式会社日本経済新聞社によって独自に開発された手法によって、算出される著作物であり、株式会社日本経済新聞社は、日経平均株価自体および日経平均株価を算定する手法に対して、著作権その他一切の知的財産権を有しています。
- 日経および日経平均株価を示す標章に関する商標権その他の知的財産権は、全て株式会社日本経済新聞社に帰属しています。
- 当ファンドは、委託会社の責任のもとで運用されるものであり、株式会社日本経済新聞社は、その運用および当ファンドの取引に関して、一切の責任を負いません。
- 株式会社日本経済新聞社は、日経平均株価を継続的に公表する義務を負うものではなく、公表の誤謬、遅延または中断に関して、責任を負いません。
- 株式会社日本経済新聞社は、日経平均株価の構成銘柄、計算方法、日経平均株価の内容を変える権利および公表を停止する権利を有しています。

**<先進国株インデックス、新興国株インデックス>**

MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円換算ベース)およびMSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円換算ベース)は、MSCI INC. (以下「MSCI」)が公表する指数(MSCIコクサイ・インデックスおよびMSCIエマージング・マーケット・インデックス)を基に委託会社が換算したものです。

当ファンドは、MSCI、その関連会社、情報提供会社またはMSCI INDEXの編集または計算に関連するその他の第三者(総称して「MSCI当事者」といいます。)が支援、保証、売却または宣伝するものではありません。

MSCI INDEXは、MSCIの専有財産です。

MSCIおよびMSCI INDEXの名称は、MSCIもしくはその関連会社のサービスマークであり、委託会社による特定の目的のための使用について許可されているものです。

いかなるMSCI当事者も、委託会社、受益者、またはその他の個人もしくは事業体に対して、ファンド投資一般、当ファンドへの投資、もしくはMSCI INDEXが対応する株式市場パフォーマンスを記録する能力に関して、明示・黙示を問わず一切の表明または保証を行いません。

MSCIもしくは関連会社は、当ファンド、委託会社、受益者、その他の個人もしくは事業体とは無関係にMSCIが決定、構成、計算するMSCI INDEXに関する特定の商標、サービスマーク、商号のライセンサーです。

いかなるMSCI当事者も、MSCI INDEXについて決定、構成または計算するにあたり、委託会社または受益者、またはその他のあらゆる個人または事業体のニーズを考慮する義務を負いません。

いかなるMSCI当事者も、当ファンドの発行時期、価格、数量に関する決定、当ファンドの償還価格および数式の決定および算定に参加しておらず、かつその責任を負いません。

さらに、いかなるMSCI当事者も、当ファンドの運営、マーケティング、またはオフリングに関連して、委託会社、受益者、その他の個人もしくは事業体に対して一切の義務または責任を負いません。

MSCIは、MSCIが信頼できると考える情報源からMSCI INDEXの算出に使用するための情報を入手するものとしませんが、いずれのMSCI当事者も、MSCI INDEXまたはそのデータの独創性、正確性、完全性について一切保証しません。

MSCI当事者は、委託会社、受益者、その他の個人もしくは事業体がMSCI INDEXもしくはそのデータを使用して得る情報またはその結果に関して、明示・黙示の保証をしません。

MSCI当事者は、MSCI INDEXもしくはそのデータについての、もしくはそれらに関連する誤り、省略、中断について一切の責任を負いません。

さらに、MSCI当事者は、いかなる種類の明示・黙示の保証責任も負わず、MSCI INDEXもしくはそのデータに関して、商品性および特定目的への適合性に関する保証をここに明確に否認します。上記のいずれをも制限することなく、いかなるMSCI当事者も、直接、間接、特別、懲罰的、結果的な損害、およびその他の損害(逸失利益を含む)について、そのような損害の可能性について通知された場合においても、一切責任を負いません。

**<先進国債インデックス>**

FTSE世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース)は、FTSE Fixed Income LLCが公表する指数(FTSE世界国債インデックス)を基に委託会社が換算したものです。

FTSE世界国債インデックスに関する著作権、知的所有権、その他一切の権利は、FTSE Fixed Income LLC に帰属します。同社は、当ファンドのスポンサーではなく、当ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、同社は、当該データの正確性および完全性を保証せず、データの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。また、同社は当ファンドの取引および運用成果等に関して一切責任を負いません。

**<新興国債インデックス>**

JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス(円換算ベース)は、J.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが公表する指数(JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス)を基に委託会社が換算したものです。

JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラスは、信頼できるとされる情報に基づいて作成していますが、J.P. Morganはその完全性・正確性を保証するものではありません。委託会社は同インデックスの使用許諾を得て使用しています。J.P. Morganからの書面による事前承諾なく同インデックスを複製・使用・頒布することは禁じられています。また、J.P. Morganは当ファンドの取引および運用成果等に関して一切責任を負いません。Copyright © 2021, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.

**<グリーインデックス>**

S&P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、円換算ベース)は、S&Pダウ・ジョーンズ・インデックスLLCが公表する指数(S&P先進国REIT指数)を基に委託会社が換算したものです。

S&P先進国REIT指数は、S&P Dow Jones Indices LLCまたはその関連会社(以下「SPDJI」といいます。)の商品であり、これを利用するライセンスが委託会社に付与されています。Standard & Poor's®およびS&P®は、Standard & Poor's Financial Services LLC(以下「S&P」といいます。)の登録商標で、Dow Jones®は、Dow Jones Trademark Holdings LLC(以下「Dow Jones」といいます。)の登録商標です。指数に直接投資することはできません。当ファンドは、SPDJI、Dow Jones、S&P、それらの各関連会社(総称して「S&P Dow Jones Indices」といいます。)によってスポンサー、保証、販売、または販売促進されているものではありません。S&P Dow Jones Indicesは当ファンドの所有者またはいかなる一般人に対して、株式全般または具体的に当ファンドへの投資の妥当性、あるいは全般的な市場のパフォーマンスを追跡するS&P先進国REIT指数の能力に関して、明示または黙示を問わず、いかなる表明または保証もしません。指数の過去のパフォーマンスは、将来の成績を示唆または保証するものでもありません。S&P先進国REIT指数に関して、S&P Dow Jones Indicesおよび委託会社との間にある唯一の関係は、同インデックスとS&P Dow Jones Indicesおよび/またはそのライセンサーの特定の商標、サービスマーク、および/または商標名のライセンス供与です。S&P先進国REIT指数は委託会社に関係なく、S&P Dow Jones Indicesによって決定、構成、計算されます。S&P Dow Jones Indicesは、S&P先進国REIT指数の決定、構成または計算において委託会社および当ファンドの所有者のニーズを考慮する義務を負いません。S&P Dow Jones Indicesは、当ファンドの価格および数量、または当ファンドの発行または販売のタイミングの決定、もしくは場合によっては当ファンドが将来換金、譲渡、または償還される計算式の決定または計算に関して、責任を負わず、またこれに関与したこともありません。S&P Dow Jones Indicesは、当ファンドの管理、マーケティング、または取引に関して、いかなる義務または責任も負いません。S&P先進国REIT指数に基づく投資商品が、指数のパフォーマンスを正確に追跡する、またはプラスの投資収益率を提供する保証はありません。S&P Dow Jones Indices LLCは投資または税務の顧問会社ではありません。免税証券のポートフォリオへの影響や特定の投資決断の税効果の評価は、税務顧問会社に相談してください。指数に証券が含まれることは、S&P Dow Jones Indicesがかかる証券の売り、買い、またはホールドの推奨を意味するものではなく、投資アドバイスとして見なしてはなりません。

S&P Dow Jones Indicesは、S&P先進国REIT指数またはその関連データ、あるいは口頭または書面の通信(電子通信も含みます。)を含むがこれに限定されないあらゆる通信について、その妥当性、正確性、適時性、または完全性を保証しません。S&P Dow Jones Indicesは、これに含まれる過誤、遺漏または中断に対して、いかなる義務または責任も負わないものとします。S&P Dow Jones Indicesは、明示的または黙示的を問わず、いかなる保証もせず、商品性、特定の目的または使用への適合性、もしくはS&P先進国REIT指数を使用することによって、またはそれに関連するデータに関して、委託会社、当ファンドの所有者、またはその他の人物や組織が得られる結果について、一切の保証を明示的に否認します。上記を制限することなく、いかなる場合においても、S&P Dow Jones Indicesは、利益の逸失、営業損失、時間または信用の喪失を含むがこれらに限定されない、間接的、特別、懲罰的、または派生的損害に対して、たとえその可能性について知らされていたとしても、契約の記述、不法行為、または厳格責任の有無を問わず、一切の責任を負わないものとします。S&P Dow Jones Indicesのライセンサーを除き、S&P Dow Jones Indicesと委託会社との間の契約または取り決めの第三者受益者は存在しません。

**<ゴールドインデックスヘッジ有>**

LBMA金価格(円ヘッジ換算ベース)は、ICEベンチマーク・アドミニストレーション・リミテッド(ICE Benchmark Administration Limited)が公表する指数(LBMA金価格)を基に委託会社が換算したものです。

LBMA金価格はICEベンチマーク・アドミニストレーション・リミテッドが算出し公表している指数であり、同社は、LBMA金価格及びLBMA金価格が示す、あらゆる特定の日、特定の時点における数値により生じた結果について、明示的又は暗示的に、何ら保証するものではありません。ICEベンチマーク・アドミニストレーション・リミテッドは、当ファンドに関する商品性や特定目的への適合性について、明示的又は暗示的に、何ら保証するものではありません。

**(2)【投資対象】****イ 投資対象とする資産の種類**

- 三井住友D S・TOPIXインデックス・ファンド
- 三井住友D S・日経225インデックス・ファンド
- 三井住友D S・先進国株式インデックス・ファンド
- 三井住友D S・新興国株式インデックス・ファンド
- 三井住友D S・先進国債インデックス・ファンド
- 三井住友D S・新興国債インデックス・ファンド
- 三井住友D S・国内リートインデックス・ファンド
- 三井住友D S・先進国リートインデックス・ファンド

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

(イ)次に掲げる特定資産(投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項の「特定資産」をいいます。以下同じ。)

1. 有価証券
2. デリバティブ取引にかかる権利
3. 約束手形(金融商品取引法第2条第1項第15号に掲げるものを除きます。)
4. 金銭債権

(口) 特定資産以外の資産で、以下に掲げる資産

1. 為替手形

三井住友D S・ゴールドインデックス・ファンド(為替ヘッジあり)

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

(イ) 次に掲げる特定資産(投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項の「特定資産」をいいます。以下同じ。)

1. 有価証券

2. 約束手形(金融商品取引法第2条第1項第15号に掲げるものを除きます。)

3. 金銭債権

(ロ) 特定資産以外の資産で、以下に掲げる資産

1. 為替手形

ロ 投資対象とする有価証券

三井住友D S・T O P I Xインデックス・ファンド

三井住友D S・日経225インデックス・ファンド

三井住友D S・先進国株式インデックス・ファンド

三井住友D S・新興国株式インデックス・ファンド

三井住友D S・先進国債インデックス・ファンド

三井住友D S・新興国債インデックス・ファンド

委託会社は、信託金を、主として、各マザーファンドの受益証券または次の有価証券(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。)に投資することを指図します。

1. 株券または新株引受権証書

2. 国債証券

3. 地方債証券

4. 特別の法律により法人の発行する債券

5. 社債券(新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券(以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。))の新株引受権証券を除きます。)

6. 資産の流動化に関する法律に規定する特定社債券(金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。)

7. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券(金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。)

8. 協同組織金融機関にかかる優先出資証券(金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。)

9. 資産の流動化に関する法律に規定する優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券(金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。)

10. 資産の流動化に関する法律に規定する特定目的信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第13号で定めるものをいいます。)

11. コマーシャル・ペーパー

12. 新株引受権証券(分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。))および新株予約権証券

13. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前各号の証券または証書の性質を有するもの

14. 投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。)

15. 投資証券もしくは新投資口予約権証券または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。次号において同じ。))で次号に定めるもの以外のもの

16. 投資法人債券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下本号において同じ。))または外国投資証券で投資法人債券に類する証券

17. 外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)

18. オプションを表示する証券または証書(金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券にかかるものに限ります。)
  19. 預託証書(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)
  20. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
  21. 受益証券発行信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定めるものをいいます。)
  22. 外国の者に対する権利で、貸付債権信託受益権であって前号の有価証券に表示されるべき権利の性質を有するもの
  23. 抵当証券(金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。)
- なお、第1号の証券または証書、ならびに第13号、第19号および第21号の証券または証書のうち第1号の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、第2号から第6号までの証券および第16号の証券ならびに第13号、第19号および第21号の証券または証書のうち第2号から第6号までの証券の性質を有するものならびに第19号および第21号の証券または証書のうち第16号の証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、第14号および第15号の証券ならびに第19号および第21号の証券または証書のうち第14号および第15号の証券の性質を有するものを以下「投資信託証券」といいます。

#### 三井住友D S・国内リートインデックス・ファンド

委託会社は、信託金を、主として、マザーファンドの受益証券または次の有価証券(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。)に投資することを指図します。

1. 国債証券、地方債証券、特別の法律により法人の発行する債券および社債券(新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券および短期社債等を除きます。)
2. コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等
3. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前号の証券または証書の性質を有するもの
4. 投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。)
5. 投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)
6. 外国法人が発行する譲渡性預金証書

なお、第1号の証券にかかる運用の指図は買い現先取引(売戻条件付の買入れ)および債券貸借取引(現金担保付債券借入れ)に限り行うことができるものとします。また、第4号の証券および第5号の証券を以下「投資信託証券」といいます。

#### 三井住友D S・先進国リートインデックス・ファンド

##### 三井住友D S・ゴールドインデックス・ファンド(為替ヘッジあり)

委託会社は、信託金を、主として、各マザーファンドの受益証券または次の有価証券(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。)に投資することを指図します。

1. 国債証券、地方債証券、特別の法律により法人の発行する債券および社債券(新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券および短期社債等を除きます。)
2. コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等
3. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前号の証券または証書の性質を有するもの
4. 投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。)
5. 投資証券または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)
6. 外国法人が発行する譲渡性預金証書

なお、第1号の証券にかかる運用の指図は買い現先取引(売戻条件付の買入れ)および債券貸借取引(現金担保付債券借入れ)に限り行うことができるものとします。また、第4号の証券および第5号の証券を以下「投資信託証券」といいます。

## 八 投資対象とする金融商品

- 三井住友D S ・ T O P I X インデックス・ファンド
- 三井住友D S ・ 日経 2 2 5 インデックス・ファンド
- 三井住友D S ・ 先進国株式インデックス・ファンド
- 三井住友D S ・ 新興国株式インデックス・ファンド
- 三井住友D S ・ 先進国債インデックス・ファンド
- 三井住友D S ・ 新興国債インデックス・ファンド

委託会社は、信託金を、上記口に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。

- 1．預金
- 2．指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
- 3．コール・ローン
- 4．手形割引市場において売買される手形
- 5．貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
- 6．外国の者に対する権利で前号の権利の性質を有するもの

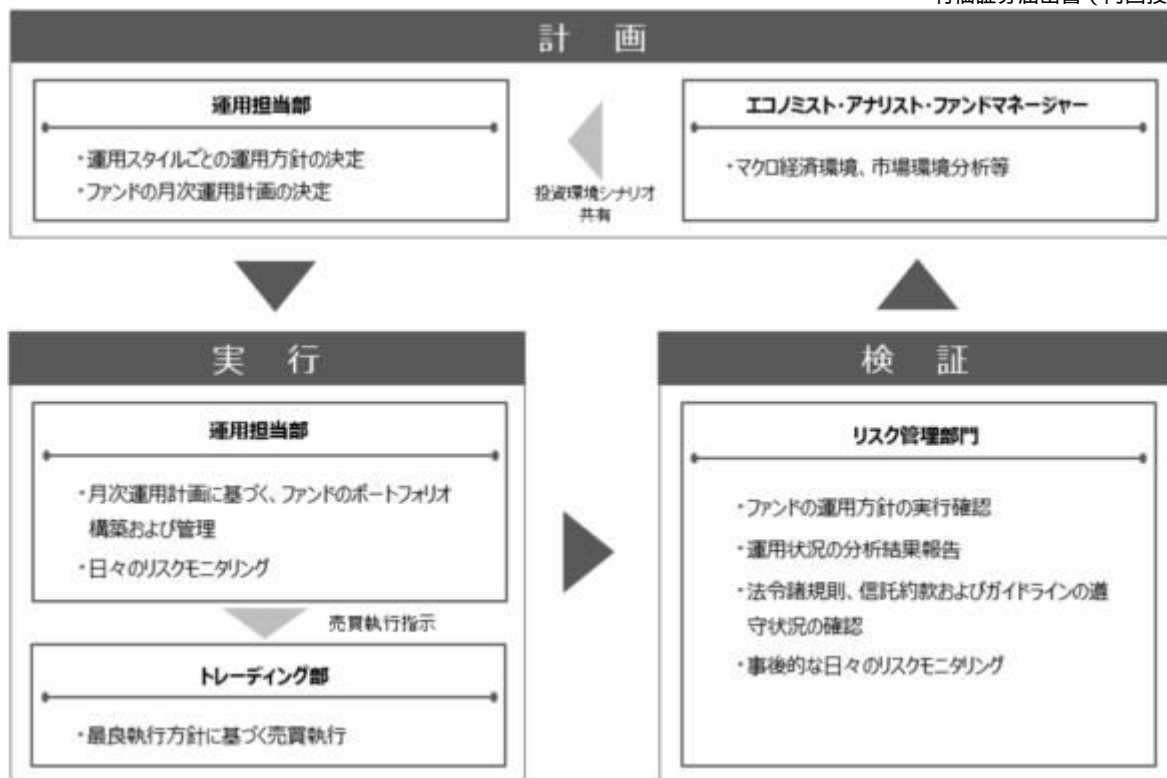
- 三井住友D S ・ 国内リートインデックス・ファンド
- 三井住友D S ・ 先進国リートインデックス・ファンド
- 三井住友D S ・ ゴールドインデックス・ファンド（為替ヘッジあり）

委託会社は、信託金を、上記口に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。

- 1．預金
- 2．指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
- 3．コール・ローン
- 4．手形割引市場において売買される手形

### （3）【運用体制】

#### イ ファンドの運用体制



リスク管理部門の人員数は、約40名です。

ファンドの運用体制は、委託会社の組織変更等により、変更されることがあります。

- 委託会社によるファンドの関係法人（販売会社を除く）に対する管理体制  
ファンドの受託会社に対しては、信託財産の日常の管理業務（保管・管理・計算等）を通じて、信託事務の正確性・迅速性の確認を行い、問題がある場合は適宜改善を求めています。

#### （４）【分配方針】

年１回（原則として毎年11月30日。休業日の場合は翌営業日となります。）決算を行い、原則として以下の方針に基づき分配金額を決定します。

- イ 分配対象額は、経費控除後の利子、配当等収益と売買益（評価損益を含みます。）等の範囲内とします。
- 収益分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、委託会社の判断により分配を行わない場合もあるため、将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。
- ハ 留保益の運用については特に制限を定めず、委託会社の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。

ファンドは複利効果による信託財産の成長を優先するため、分配を極力抑制します。  
（基準価額水準、市況動向等によっては変更する場合があります。）

#### （５）【投資制限】

ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限  
三井住友DS・TOPIXインデックス・ファンド

- イ 株式への実質投資割合には、制限を設けません。

実質投資割合とは、当ファンドが保有するある種類の資産の評価額が当ファンドの純資産総額に占める比率（「組入比率」といいます。）と、当該同一種類の資産のマザーファンドにおける組入比率に当該マザーファンド受益証券の当ファンドにおける組入比率を乗じて得た

率を合計したものをいいます(以下同じ。)

- 外貨建資産への投資は行いません。
- ハ 投資信託証券(マザーファンド受益証券および上場投資信託証券を除きます。)への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- ニ 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

#### 三井住友DS・日経225インデックス・ファンド

- イ 株式への実質投資割合には、制限を設けません。ただし、先物取引を含めた実質投資比率は、信託財産の純資産総額の110%以下とします。
- 外貨建資産への投資は行いません。
- ハ 投資信託証券(マザーファンド受益証券および上場投資信託証券を除きます。)への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- ニ 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

#### 三井住友DS・先進国株式インデックス・ファンド

#### 三井住友DS・新興国株式インデックス・ファンド

- イ 株式への実質投資割合には、制限を設けません。
- 外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。
- ハ 投資信託証券(マザーファンド受益証券および上場投資信託証券を除きます。)への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- ニ 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

#### 三井住友DS・先進国債インデックス・ファンド

- イ 株式(新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。)への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- 国債を除く同一発行体の発行する債券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- ハ 外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。
- ニ 投資信託証券(マザーファンド受益証券および上場投資信託証券を除きます。)への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- ホ 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

#### 三井住友DS・新興国債インデックス・ファンド

- イ 株式(新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。)への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- 外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。
- ハ 投資信託証券(マザーファンド受益証券および上場投資信託証券を除きます。)への実質投資割



合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

- ニ 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

#### 三井住友D S・国内リートインデックス・ファンド

- イ 投資信託証券への実質投資割合には、制限を設けません。
- ロ 株式への投資は行いません。
- ハ 外貨建資産への投資は行いません。
- ニ 投資信託証券とコマーシャル・ペーパーおよび短期社債等以外の有価証券への投資は、買い現先取引または債券貸借取引に限りします。
- ホ 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

#### 三井住友D S・先進国リートインデックス・ファンド

- イ 投資信託証券への実質投資割合には、制限を設けません。
- ロ 株式への投資は行いません。
- ハ 外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。
- ニ 投資信託証券とコマーシャル・ペーパーおよび短期社債等以外の有価証券への投資は、買い現先取引または債券貸借取引に限りします。
- ホ 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

#### 三井住友D S・ゴールドインデックス・ファンド（為替ヘッジあり）

- イ 投資信託証券への実質投資割合には、制限を設けません。
- ロ 投資信託証券とコマーシャル・ペーパーおよび短期社債等以外の有価証券への投資は、買い現先取引または債券貸借取引に限りします。
- ハ 外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。
- ニ 同一銘柄の投資信託証券への投資割合には、原則として制限を設けません。ただし、当該投資信託証券が一般社団法人投資信託協会規則に定めるエクスポージャーがリスクスルーできる場合に該当しないときは、当該投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。
- ホ 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

#### ファンドの信託約款に基づくその他の投資制限

##### 三井住友D S・TOPIXインデックス・ファンド

##### 三井住友D S・日経225インデックス・ファンド

- イ デリバティブ取引等にかかる投資制限  
委託会社は、デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。
- ロ 投資する株式等の範囲

- (イ) 委託会社が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、取引所に上場されている株式の発行会社の発行するもの、取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。
- (ロ) 上記(イ)にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては委託会社が投資することを指図することができるものとします。

#### 八 信用取引の指図

- (イ) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。
- (ロ) 上記(イ)の信用取引の指図は、当該売付けにかかる建玉の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該売付けにかかる建玉の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- (ハ) 上記(ロ)において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該売付けにかかる建玉の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- (ニ) 信託財産の一部解約等の事由により、上記(ロ)の売付けにかかる建玉の時価総額の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は、速やかにその超える額に相当する売付けの一部を決済するための指図をするものとします。

#### 二 先物取引等の指図

- (イ) 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、日本の取引所における有価証券先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。)、有価証券指数等先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。 )および有価証券オプション取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。 )ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取り扱うものとします(以下同じ。 )。
- (ロ) 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、日本の取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。

#### ホ スワップ取引の指図

- (イ) 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(以下「スワップ取引」といいます。 )を行うことの指図をすることができます。
- (ロ) スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- (ハ) スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額(以下「スワップ取引の想定元本の合計額」といいます。 )が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は、速やかにその超える額に相当するスワップ取引の一部の解約を指図するものとします。
- (ニ) 上記(ハ)においてマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

(ホ) スワップ取引の評価は、市場実勢金利等をもとに算出した価額により行うものとします。

(ヘ) 委託会社は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

#### ヘ 金利先渡取引の指図

(イ) 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、金利先渡取引を行うことの指図をすることができます。

(ロ) 金利先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

(ハ) 金利先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額(以下「金利先渡取引の想定元本の合計額」といいます。)が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、金利先渡取引の想定元本の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は、速やかにその超える額に相当する金利先渡取引の一部の解約を指図するものとします。

(ニ) 上記(ハ)においてマザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

(ホ) 金利先渡取引の評価は、市場実勢金利等をもとに算出した価額により行うものとします。

(ヘ) 委託会社は、金利先渡取引を行うにあたり、担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

(ト) 「金利先渡取引」とは、当事者間において、あらかじめ将来の特定の日(以下「決済日」といいます。)における決済日から一定の期間を経過した日(以下「満期日」といいます。)までの期間にかかる国内または海外において代表的利率として公表される預金契約または金銭の貸借契約に基づく債権の利率(以下「指標利率」といいます。)の数値を取り決め、その取決めにかかる数値と決済日における当該指標利率の現実の数値との差にあらかじめ元本として定めた金額および当事者間で約定した日数を基準とした数値を乗じた額を決済日における当該指標利率の現実の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。

#### ト 有価証券の貸付けの指図

(イ) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の各号の範囲内で貸し付けることの指図をすることができます。

1. 株式の貸付けは、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。

2. 公社債の貸付けは、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。

(ロ) 上記(イ)の各号に定める限度額を超えることとなった場合には、委託会社は、速やかにその超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。

(ハ) 委託会社は、有価証券の貸付けにあたって必要と認めるときは、担保の受入れの指図を行うものとします。

#### チ 有価証券の空売りの指図

(イ) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産において有しない有価証券または借り入れた有価証券を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、売り付けた有価証券の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができます。

(ロ) 上記(イ)の売付けの指図は、当該売付けにかかる有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額を超えない範囲で行うものとします。

(八) 信託財産の一部解約等の事由により、上記(ロ)の売付けにかかる有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は、速やかにその超える額に相当する売付けの一部を決済するための指図をするものとします。

#### リ 有価証券の借入れの指図

(イ) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、有価証券の借入れの指図をすることができます。なお、当該有価証券の借入れを行うにあたり担保の提供が必要と認めるときは、担保の提供の指図をするものとします。

(ロ) 上記(イ)の指図は、当該借入れにかかる有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額を超えない範囲で行うものとします。

(八) 信託財産の一部解約等の事由により、上記(ロ)の借入れにかかる有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は、速やかにその超える額に相当する借り入れた有価証券の一部を返還するための指図をするものとします。

(二) 上記(イ)の借入れにかかる品借料は、信託財産中から支弁します。

#### ヌ 資金の借入れ

(イ) 委託会社は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当て(一部解約に伴う支払資金の手当てのために借り入れた資金の返済を含みます。)を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金の借入れ(コール市場を通じる場合を含みます。)の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。

(ロ) 一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、有価証券等の売却代金、解約代金または償還金の入金日までに限るものとし、資金借入額は、次の各号に掲げる要件を満たす範囲内の額とします。

1. 一部解約金の支払資金の手当てのために行った有価証券等の売却等による受取りの確定している資金の額の範囲内
2. 一部解約金支払日の前営業日において確定した当該支払日における支払資金の不足額の範囲内
3. 借入れ指図を行う日における信託財産の純資産総額の10%以内

(八) 収益分配金の再投資にかかる借入期間は信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。

(二) 借入金の利息は、信託財産中から支弁します。

三井住友D S ・先進国株式インデックス・ファンド

三井住友D S ・新興国株式インデックス・ファンド

三井住友D S ・新興国債インデックス・ファンド

#### イ デリバティブ取引等にかかる投資制限

委託会社は、デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

#### ロ 投資する株式等の範囲

(イ) 委託会社が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、取引所に上場されている株式の発行会社の発行するもの、取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。

(ロ) 上記(イ)にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては委託会社が投資することを指図することができるものとします。

#### ハ 信用取引の指図

(イ) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。

- (ロ) 上記(イ)の信用取引の指図は、当該売付けにかかる建玉の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該売付けにかかる建玉の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- (ハ) 上記(ロ)において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該売付けにかかる建玉の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- (二) 信託財産の一部解約等の事由により、上記(ロ)の売付けにかかる建玉の時価総額の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は、速やかにその超える額に相当する売付けの一部を決済するための指図をするものとします。

## 二 先物取引等の指図

- (イ) 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、日本の取引所における有価証券先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。)、有価証券指数等先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。 )および有価証券オプシオン取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。 )ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプシオン取引に含めて取り扱うものとします(以下同じ。 )。
- (ロ) 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、日本の取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の取引所における通貨にかかる先物取引およびオプシオン取引を行うことの指図をすることができます。
- (ハ) 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、日本の取引所における金利にかかる先物取引およびオプシオン取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。

## ホ スワップ取引の指図

- (イ) 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(以下「スワップ取引」といいます。 )を行うことの指図をすることができます。
- (ロ) スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- (ハ) スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額(以下「スワップ取引の想定元本の合計額」といいます。 )が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は、速やかにその超える額に相当するスワップ取引の一部の解約を指図するものとします。
- (二) 上記(ハ)においてマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- (ホ) スワップ取引の評価は、市場実勢金利等をもとに算出した価額により行うものとします。
- (ヘ) 委託会社は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

## ヘ 金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引の指図

- (イ) 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引を

行うことの指図をすることができます。

- (ロ) 金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- (ハ) 金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下「金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引の想定元本の合計額」といいます。）が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引の想定元本の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は、速やかにその超える額に相当する金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引の一部の解約を指図するものとします。
- (ニ) 上記（ハ）においてマザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- (ホ) 金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引の評価は、市場実勢金利等をもとに算出した価額により行うものとします。
- (ヘ) 委託会社は、金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引を行うにあたり、担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。
- (ト) 「金利先渡取引」とは、当事者間において、あらかじめ将来の特定の日（以下「決済日」といいます。）における決済日から一定の期間を経過した日（以下「満期日」といいます。）までの期間にかかる国内または海外において代表的利率として公表される預金契約または金銭の貸借契約に基づく債権の利率（以下「指標利率」といいます。）の数値を取り決め、その取決めにかかる数値と決済日における当該指標利率の現実の数値との差にあらかじめ元本として定めた金額および当事者間で約定した日数を基準とした数値を乗じた額を決済日における当該指標利率の現実の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。
- (チ) 「為替先渡取引」とは、当事者間において、あらかじめ決済日から満期日までの期間にかかる為替スワップ取引（同一の相手方との間で直物外国為替取引および当該直物外国為替取引と反対売買の関係に立つ先物外国為替取引を同時に約定する取引をいいます。以下同じ。）のスワップ幅（当該直物外国為替取引にかかる外国為替相場と当該先物外国為替取引にかかる外国為替相場との差を示す数値をいいます。以下同じ。）を取り決め、その取決めにかかるスワップ幅から決済日における当該為替スワップ取引の現実のスワップ幅を差し引いた値にあらかじめ元本として定めた金額を乗じた額を決済日における指標利率の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭またはその取決めにかかるスワップ幅から決済日における当該為替スワップ取引の現実のスワップ幅を差し引いた値にあらかじめ元本として定めた金額を乗じた金額とあらかじめ元本として定めた金額について決済日を受渡日として行った先物外国為替取引を決済日における直物外国為替取引で反対売買したときの差金にかかる決済日から満期日までの利息とを合算した額を決済日における指標利率の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。
- (リ) 「直物為替先渡取引」とは、当事者間において、あらかじめ元本として定めた金額について決済日を受渡日として行った先物外国為替取引を決済日における直物外国為替取引で反対売買したときの差金の授受を約する取引、その他これに類似する取引をいいます。

#### ト 有価証券の貸付けの指図

- (イ) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次

の各号の範囲内で貸し付けることの指図をすることができます。

1. 株式の貸付けは、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。
2. 公社債の貸付けは、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。

(ロ) 上記(イ)の各号に定める限度額を超えることとなった場合には、委託会社は、速やかにその超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。

(ハ) 委託会社は、有価証券の貸付けにあたって必要と認めるときは、担保の受入れの指図を行うものとします。

#### チ 有価証券の空売りの指図

(イ) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産において有しない有価証券または借り入れた有価証券を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、売り付けた有価証券の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。

(ロ) 上記(イ)の売付けの指図は、当該売付けにかかる有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額を超えない範囲で行うものとします。

(ハ) 信託財産の一部解約等の事由により、上記(ロ)の売付けにかかる有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は、速やかにその超える額に相当する売付けの一部を決済するための指図をするものとします。

#### リ 有価証券の借入れの指図

(イ) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、有価証券の借入れの指図をすることができます。なお、当該有価証券の借入れを行うにあたり担保の提供が必要と認めるときは、担保の提供の指図をするものとします。

(ロ) 上記(イ)の指図は、当該借入れにかかる有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額を超えない範囲で行うものとします。

(ハ) 信託財産の一部解約等の事由により、上記(ロ)の借入れにかかる有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は、速やかにその超える額に相当する借り入れた有価証券の一部を返還するための指図をするものとします。

(ニ) 上記(イ)の借入れにかかる品借料は、信託財産中から支弁します。

#### ヌ 特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

外貨建有価証券への投資については、日本の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。

#### ル 外国為替予約取引の指図

(イ) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、ならびに信託財産に属する外貨建資産の為替変動リスクを回避するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。

(ロ) 外国為替予約取引の指図は、信託財産にかかる為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産（マザーファンドの信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額を含みます。）の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。

(ハ) 上記(ロ)の限度額を超えることとなった場合には、委託会社は所定の期間内に、その超える額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引の指図をするものとします。

(ニ) 上記(ロ)において、信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

#### ヲ 資金の借入れ

(イ) 委託会社は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借り入れた資金の返済を含みま

す。)を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金の借入れ(コール市場を通じる場合を含みます。)の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。

- (ロ) 一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、有価証券等の売却代金、解約代金または償還金の入金日までに限るものとし、資金借入額は、次の各号に掲げる要件を満たす範囲内の額とします。
  1. 一部解約金の支払資金の手当てのために行った有価証券等の売却等による受取りの確定している資金の額の範囲内
  2. 一部解約金支払日の前営業日において確定した当該支払日における支払資金の不足額の範囲内
  3. 借入れ指図を行う日における信託財産の純資産総額の10%以内
- (ハ) 収益分配金の再投資にかかる借入期間は信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。
- (ニ) 借入金の利息は、信託財産中から支弁します。

### 三井住友DS・先進国債インデックス・ファンド

#### イ デリバティブ取引等にかかる投資制限

委託会社は、デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

#### ロ 投資する株式等の範囲

- (イ) 委託会社が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、取引所に上場されている株式の発行会社の発行するもの、取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。
- (ロ) 上記(イ)にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては委託会社が投資することを指図することができるものとします。

#### ハ 同一発行体の発行する公社債への投資制限

- (イ) 委託会社は、信託財産に属する同一の発行体にかかる公社債(日本および外国の国債証券を除きます。以下同じ。)の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該同一発行体にかかる公社債の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。
- (ロ) 上記(イ)において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

#### ニ 信用取引の指図

- (イ) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。
- (ロ) 上記(イ)の信用取引の指図は、当該売付けにかかる建玉の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該売付けにかかる建玉の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- (ハ) 上記(ロ)において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該売付けにかかる建玉の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- (ニ) 信託財産の一部解約等の事由により、上記(ロ)の売付けにかかる建玉の時価総額の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は、速やかにその超える額に相当する売付けの一部を決済するための指図をするものとします。

#### ホ 先物取引等の指図



- (イ) 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、日本の取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取り扱うものとします（以下同じ。）。
- (ロ) 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、日本の取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を行うことの指図をすることができます。
- (ハ) 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、日本の取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。

#### ヘ スワップ取引の指図

- (イ) 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことの指図をすることができます。
- (ロ) スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- (ハ) スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下「スワップ取引の想定元本の合計額」といいます。）が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は、速やかにその超える額に相当するスワップ取引の一部の解約を指図するものとします。
- (ニ) 上記（ハ）においてマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- (ホ) スワップ取引の評価は、市場実勢金利等をもとに算出した価額により行うものとします。
- (ヘ) 委託会社は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

#### ト 金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引の指図

- (イ) 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。
- (ロ) 金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- (ハ) 金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下「金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引の想定元本の合計額」といいます。）が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、金利先

渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引の想定元本の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は、速やかにその超える額に相当する金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引の一部の解約を指図するものとします。

- (二) 上記(八)においてマザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- (ホ) 金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引の評価は、市場実勢金利等をもとに算出した価額により行うものとします。
- (ヘ) 委託会社は、金利先渡取引、為替先渡取引および直物為替先渡取引を行うにあたり、担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。
- (ト) 「金利先渡取引」とは、当事者間において、あらかじめ将来の特定の日(以下「決済日」といいます。)における決済日から一定の期間を経過した日(以下「満期日」といいます。)までの期間にかかる国内または海外において代表的利率として公表される預金契約または金銭の貸借契約に基づく債権の利率(以下「指標利率」といいます。)の数値を取り決め、その取決めにかかる数値と決済日における当該指標利率の現実の数値との差にあらかじめ元本として定めた金額および当事者間で約定した日数を基準とした数値を乗じた額を決済日における当該指標利率の現実の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。
- (チ) 「為替先渡取引」とは、当事者間において、あらかじめ決済日から満期日までの期間にかかる為替スワップ取引(同一の相手方との間で直物外国為替取引および当該直物外国為替取引と反対売買の関係に立つ先物外国為替取引を同時に約定する取引をいいます。以下同じ。)のスワップ幅(当該直物外国為替取引にかかる外国為替相場と当該先物外国為替取引にかかる外国為替相場との差を示す数値をいいます。以下同じ。)を取り決め、その取決めにかかるスワップ幅から決済日における当該為替スワップ取引の現実のスワップ幅を差し引いた値にあらかじめ元本として定めた金額を乗じた額を決済日における指標利率の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭またはその取決めにかかるスワップ幅から決済日における当該為替スワップ取引の現実のスワップ幅を差し引いた値にあらかじめ元本として定めた金額を乗じた金額とあらかじめ元本として定めた金額について決済日を受渡日として行った先物外国為替取引を決済日における直物外国為替取引で反対売買したときの差金にかかる決済日から満期日までの利息とを合算した額を決済日における指標利率の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。
- (リ) 「直物為替先渡取引」とは、当事者間において、あらかじめ元本として定めた金額について決済日を受渡日として行った先物外国為替取引を決済日における直物外国為替取引で反対売買したときの差金の授受を約する取引、その他これに類似する取引をいいます。

#### チ 有価証券の貸付けの指図

- (イ) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の各号の範囲内で貸し付けることの指図をすることができます。
1. 株式の貸付けは、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。
  2. 公社債の貸付けは、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。
- (ロ) 上記(イ)の各号に定める限度額を超えることとなった場合には、委託会社は、速やかにその超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。
- (ハ) 委託会社は、有価証券の貸付けにあたって必要と認めるときは、担保の受入れの指図を行うものとします。

#### リ 有価証券の空売りの指図

- (イ) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産において有しない有価証券または借り入れた有価証券を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、売り付けた有価証券の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。
- (ロ) 上記(イ)の売付けの指図は、当該売付けにかかる有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額を超えない範囲で行うものとします。
- (ハ) 信託財産の一部解約等の事由により、上記(ロ)の売付けにかかる有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は、速やかにその超える額に相当する売付けの一部を決済するための指図をするものとします。

#### ヌ 有価証券の借入れの指図

- (イ) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、有価証券の借入れの指図をすることができます。なお、当該有価証券の借入れを行うにあたり担保の提供が必要と認めるときは、担保の提供の指図をするものとします。
- (ロ) 上記(イ)の指図は、当該借入れにかかる有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額を超えない範囲で行うものとします。
- (ハ) 信託財産の一部解約等の事由により、上記(ロ)の借入れにかかる有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は、速やかにその超える額に相当する借り入れた有価証券の一部を返還するための指図をするものとします。
- (ニ) 上記(イ)の借入れにかかる品借料は、信託財産中から支弁します。

#### ル 特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

外貨建有価証券への投資については、日本の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。

#### ロ 外国為替予約取引の指図

- (イ) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、ならびに信託財産に属する外貨建資産の為替変動リスクを回避するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。
- (ロ) 外国為替予約取引の指図は、信託財産にかかる為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産(マザーファンドの信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額を含みます。)の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。
- (ハ) 上記(ロ)の限度額を超えることとなった場合には、委託会社は所定の期間内に、その超える額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引の指図をするものとします。
- (ニ) 上記(ロ)において、信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

#### ワ 資金の借入れ

- (イ) 委託会社は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当て(一部解約に伴う支払資金の手当てのために借り入れた資金の返済を含みます。)を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金の借入れ(コール市場を通じる場合を含みます。)の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。
- (ロ) 一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、有価証券等の売却代金、解約代金または償還金の入金日までに限るものとし、資金借入額は、次の各号に掲げる要件を満たす範囲内の額とします。
  1. 一部解約金の支払資金の手当てのために行った有価証券等の売却等による受取りの確定している資金の額の範囲内
  2. 一部解約金支払日の前営業日において確定した当該支払日における支払資金の不足額の範囲内

3．借入れ指図を行う日における信託財産の純資産総額の10%以内

- (ハ) 収益分配金の再投資にかかる借入期間は信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。
- (ニ) 借入金の利息は、信託財産中から支弁します。

#### 三井住友D S ・国内リートインデックス・ファンド

##### イ デリバティブ取引等にかかる投資制限

委託会社は、デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

##### ロ 公社債の借入れの指図

- (イ) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。なお、当該公社債の借入れを行うにあたり担保の提供が必要と認められたときは、担保の提供の指図をするものとします。
- (ロ) 上記(イ)の指図は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えない範囲で行うものとします。
- (ハ) 信託財産の一部解約等の事由により、上記(ロ)の借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する借り入れた公社債の一部を返還するための指図をするものとします。
- (ニ) 上記(イ)の借入れにかかる品借料は、信託財産中から支弁します。

##### ハ 先物取引等の指図

委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、日本の取引所における不動産投信指数先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるもののうち、不動産投信指数にかかるものをいいます。）ならびに外国の取引所におけるこれと類似の取引を行うことの指図をすることができます。

##### 二 資金の借入れ

- (イ) 委託会社は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借り入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金の借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。
- (ロ) 一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、有価証券等の売却代金、解約代金または償還金の入金日までに限るものとし、資金借入額は、次の各号に掲げる要件を満たす範囲内の額とします。
  - 1．一部解約金の支払資金の手当てのために行った有価証券等の売却等による受取りの確定している資金の額の範囲内
  - 2．一部解約金支払日の前営業日において確定した当該支払日における支払資金の不足額の範囲内
  - 3．借入れ指図を行う日における信託財産の純資産総額の10%以内
- (ハ) 収益分配金の再投資にかかる借入期間は、信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。
- (ニ) 借入金の利息は、信託財産中から支弁します。

#### 三井住友D S ・先進国リートインデックス・ファンド

##### イ デリバティブ取引等にかかる投資制限

委託会社は、デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

##### ロ 公社債の借入れの指図

- (イ) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。なお、当該公社債の借入れを行うにあたり担保の提供が必要と認められたときは、担保の提

供の指図をするものとします。

- (ロ) 上記(イ)の指図は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えない範囲で行うものとします。
- (ハ) 信託財産の一部解約等の事由により、上記(ロ)の借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する借り入れた公社債の一部を返還するための指図をするものとします。
- (ニ) 上記(イ)の借入れにかかる品借料は、信託財産中から支弁します。

#### 八 特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

外貨建有価証券への投資については、日本の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。

#### 二 外国為替予約取引の指図

委託会社は、信託財産に属する外貨建資産とマザーファンドの信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額(信託財産に属するマザーファンドの時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。)との合計額について、当該外貨建資産の為替ヘッジのため、外国為替の売買の予約を指図することができます。

#### ホ 先物取引等の指図

委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、日本の取引所における不動産投信指数先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号口に掲げるもののうち、不動産投信指数にかかるものをいいます。)ならびに外国の取引所におけるこれと類似の取引を行うことの指図をすることができます。

#### ヘ 資金の借入れ

- (イ) 委託会社は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当て(一部解約に伴う支払資金の手当てのために借り入れた資金の返済を含みます。)を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金の借入れ(コール市場を通じる場合を含みます。)の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。
- (ロ) 一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、有価証券等の売却代金、解約代金または償還金の入金日までに限るものとし、資金借入額は、次の各号に掲げる要件を満たす範囲内の額とします。
  1. 一部解約金の支払資金の手当てのために行った有価証券等の売却等による受取りの確定している資金の額の範囲内
  2. 一部解約金支払日の前営業日において確定した当該支払日における支払資金の不足額の範囲内
  3. 借入れ指図を行う日における信託財産の純資産総額の10%以内
- (ハ) 収益分配金の再投資にかかる借入期間は、信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。
- (ニ) 借入金の利息は、信託財産中から支弁します。

三井住友DS・ゴールドインデックス・ファンド(為替ヘッジあり)

#### イ 公社債の借入れの指図

- (イ) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。なお、当該公社債の借入れを行うにあたり担保の提供が必要と認められたときは、担保の提供の指図をするものとします。
- (ロ) 上記(イ)の指図は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えない範囲で行うものとします。
- (ハ) 信託財産の一部解約等の事由により、上記(ロ)の借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は、速やかにその超える額に相当する借り入れた公社債の一部を返還するための指図をするものとします。

(二) 上記(イ)の借入れにかかる品借料は、信託財産中から支弁します。

□ 特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

外貨建有価証券への投資については、日本の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。

八 外国為替予約取引の指図

委託会社は、信託財産に属する外貨建資産とマザーファンドの信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額（信託財産に属するマザーファンドの時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。）との合計額について、当該外貨建資産の為替ヘッジのため、外国為替の売買の予約を指図することができます。

二 資金の借入れ

(イ) 委託会社は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借り入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金の借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。

(ロ) 一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、有価証券等の売却代金、解約代金または償還金の入金日までに限るものとし、資金借入額は、次の各号に掲げる要件を満たす範囲内の額とします。

1. 一部解約金の支払資金の手当てのために行った有価証券等の売却等による受取りの確定している資金の額の範囲内
2. 一部解約金支払日の前営業日において確定した当該支払日における支払資金の不足額の範囲内
3. 借入れ指図を行う日における信託財産の純資産総額の10%以内

(ハ) 収益分配金の再投資にかかる借入期間は、信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。

(二) 借入金の利息は、信託財産中から支弁します。

法令に基づく投資制限

イ 同一法人の発行する株式への投資制限（投資信託及び投資法人に関する法律第9条）

委託会社は、同一の法人の発行する株式を、その運用の指図を行うすべての委託者指図型投資信託につき、信託財産として有する当該株式にかかる議決権の総数（株主総会において決議をすることができる事項の全部につき議決権を行使することができない株式についての議決権を除き、会社法第879条第3項の規定により議決権を有するものとみなされる株式についての議決権を含みます。）が、当該株式にかかる議決権の総数に100分の50を乗じて得た数を超えることとなる場合においては、信託財産をもって当該株式を取得することを受託会社に指図することが禁じられています。

ロ デリバティブ取引にかかる投資制限（金融商品取引業等に関する内閣府令第130条第1項第8号）

委託会社は、信託財産に関し、金利、通貨の価格、金融商品市場における相場その他の指標にかかる変動その他の理由により発生し得る危険に対応する額としてあらかじめ委託会社が定めた合理的な方法により算出した額が当該信託財産の純資産額を超えることとなる場合において、デリバティブ取引（新株予約権証券またはオプションを表示する証券もしくは証書にかかる取引および選択権付債券売買を含みます。）を行い、または継続することを受託会社に指図しないものとします。

八 信用リスク集中回避のための投資制限（金融商品取引業等に関する内閣府令第130条第1項第8号の2）

委託会社は、運用財産に関し、信用リスク（保有する有価証券その他の資産について取引の相手方の債務不履行その他の理由により発生し得る危険をいいます。）を適正に管理する方法として

あらかじめ委託会社が定めた合理的な方法に反することとなる取引を行うことを受託会社に指図しないものとします。

(参考情報：マザーファンドの投資方針等)

(国内株式インデックス・マザーファンド(B号))

(1) 投資方針等

イ 基本方針

主として日本の株式に投資し、TOPIX(東証株価指数、配当込み)の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。

ロ 投資態度

(イ) 主としてTOPIX(東証株価指数)に採用されている銘柄の株式に投資を行い、TOPIX(東証株価指数、配当込み)の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。

(ロ) 株価指数先物取引等を含む株式の実質組入比率は、原則として高位を保ちます。ただし、資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

(ハ) 株式以外の資産への投資割合は、原則として信託財産総額の50%以下とします。

(2) 投資対象

イ 投資対象とする資産の種類

前記「2 投資方針 (2) 投資対象 イ 投資対象とする資産の種類」において記載したベビーファンドが投資対象とする資産の種類に同じです。

ロ 投資対象とする有価証券

委託会社は、信託金を、主として次の有価証券(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除き、かつ本邦通貨表示のものに限ります。)に投資することを指図します。

1. 株券または新株引受権証書

2. 国債証券

3. 特別の法律により法人の発行する債券

4. コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等

5. 投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。)

6. 外国法人が発行する譲渡性預金証書

7. 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)

ハ 投資対象とする金融商品

前記「2 投資方針 (2) 投資対象 ハ 投資対象とする金融商品」において記載した三井住友DS・TOPIXインデックス・ファンドが投資対象とする金融商品の各号のうち、第1号から第4号に掲げるものに投資します。

(3) 投資制限

イ ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

(イ) 外貨建資産への投資は行いません。

(ロ) 株式への投資割合には制限を設けません。

(ハ) 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

(ニ) デリバティブ取引(法人税法第61条の5に定めるものをいいます。)は、価格変動リスクおよび金利変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現す

る目的以外には利用しません。

## (225マザーファンド)

### (1)投資方針等

#### イ 基本方針

日経平均株価(日経225)に連動する投資成果をめざした運用を行うことを基本とします。

#### ロ 投資態度

(イ)日経平均株価(日経225)に採用されている銘柄に原則として、投資を行います。

(ロ)株式の組入比率は高位を保ちます。

(ハ)運用の効率化を図るため、日経平均先物取引を利用することもあります。

(ニ)株式の実質投資比率は、原則として、純資産総額の+110%以内とします。また、実質投資比率が前記の上限を超過した場合には、すみやかに調整するものとします。なお、実質投資比率は、現物資産の時価総額と先物の買建玉の時価総額の合計額から先物の売建玉の時価総額を差引いた額の、純資産総額に対する比率をいいます。

(ホ)資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記のような運用ができない場合があります。

### (2)投資対象

#### イ 投資対象とする資産の種類

前記「2 投資方針 (2)投資対象 イ 投資対象とする資産の種類」において記載したベビーファンドが投資対象とする資産の種類に同じです。

#### ロ 投資対象とする有価証券

委託会社は、信託金を、主として次の有価証券(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。)に投資することを指図します。

1.株券または新株引受権証書

2.コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等

3.外国または外国の者の発行する本邦通貨表示の証券で、前号の証券の性質有するもの

4.指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)

5.抵当証券(金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。)

6.貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの

なお、第1号の証券または証書を以下「株式」といいます。

#### ハ 投資対象とする金融商品

前記「2 投資方針 (2)投資対象 ハ 投資対象とする金融商品」において記載した三井住友DS・225インデックス・ファンドが投資対象とする金融商品に同じです。

### (3)投資制限

#### イ ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

(イ)株式への投資割合には制限を設けません。

(ロ)一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

## (外国株式インデックス・マザーファンド)

### (1)投資方針等

#### イ 基本方針



主として日本を除く世界各国の株式に投資し、MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円換算ベース)の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。

#### ロ 投資態度

- (イ) 主として世界各国の株式に投資し、MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円換算ベース)の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。
- (ロ) 外貨建資産については、原則として対円で為替ヘッジを行わないものとします。
- (ハ) 株価指数先物取引等を含む株式の実質組入比率は、原則として高位を保ちます。ただし、資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

### (2) 投資対象

#### イ 投資対象とする資産の種類

前記「2 投資方針 (2) 投資対象 イ 投資対象とする資産の種類」において記載したベビーファンドが投資対象とする資産の種類に同じです。

#### ロ 投資対象とする有価証券

委託会社は、信託金を、主として次の有価証券(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。)に投資することを指図します。

1. 株券または新株引受権証書
2. 国債証券
3. 特別の法律により法人の発行する債券
4. 社債券(新株引受権証書と社債券とが一体となった新株引受権付社債券(以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。))の新株引受権証券を除きます。)
5. コマーシャル・ペーパー
6. 新株引受権証券(分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。))および新株予約権証券
7. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前各号の証券または証書の性質を有するもの
8. 投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。)
9. 投資証券または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)
10. 外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)
11. オプションを表示する証券または証書(金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。)
12. 預託証書(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)
13. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
14. 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)
15. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
16. 外国の者に対する権利で前号の有価証券の性質を有するもの

#### ハ 投資対象とする金融商品

前記「2 投資方針 (2) 投資対象 ハ 投資対象とする金融商品」において記載した三井住友DS・先進国株式インデックス・ファンドが投資対象とする金融商品に同じです。

### (3) 投資制限

#### イ ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

- (イ) 株式への投資割合には制限を設けません。
- (ロ) 外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

- (八) 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
- (二) デリバティブ取引(法人税法第61条の5に定めるものをいいます。)は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。
- (ホ) 外国為替予約取引は、為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。

## (エマージング株式インデックス・マザーファンド)

### (1) 投資方針等

#### イ 基本方針

M S C Iエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円換算ベース)の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。

#### ロ 投資態度

- (イ) 主として新興国の株式(預託証券(D R)、株式の値動きに連動する有価証券を含みます。)、新興国の株式指数を対象とした先物取引および新興国の株式等を主要投資対象とする上場投資信託証券に投資し、M S C Iエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円換算ベース)の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。
- (ロ) 運用にあたっては、ファンドの資産規模、市況動向に応じて株式、株価指数先物取引、上場投資信託証券、短期公社債等および為替取引を組み合わせ運用を行います。
- (ハ) 外貨建資産について円に対する為替ヘッジは原則として行いません。
- (ニ) 資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

### (2) 投資対象

#### イ 投資対象とする資産の種類

前記「2 投資方針 (2) 投資対象 イ 投資対象とする資産の種類」において記載したベビーファンドが投資対象とする資産の種類に同じです。

#### ロ 投資対象とする有価証券

委託会社は、信託金を、主として次の有価証券(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。)に投資することを指図します。

1. 株券または新株引受権証券
2. 国債証券
3. 地方債証券
4. 特別の法律により法人の発行する債券
5. 社債券(新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券(以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。))の新株引受権証券を除きます。)
6. 特定目的会社にかかる特定社債券(金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。)
7. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券(金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。)
8. 協同組織金融機関にかかる優先出資証券(金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。)
9. 特定目的会社にかかる優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券(金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。)
10. コマーシャル・ペーパー
11. 新株引受権証券(分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。))お

## よび新株予約権証券

12. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前各号の証券または証書の性質を有するもの
13. 投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。)
14. 投資証券もしくは投資法人債券または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)
15. 外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)
16. オプションを表示する証券または証書(金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券にかかるものに限ります。)
17. 預託証書(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)
18. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
19. 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)
20. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
21. 外国の者に対する権利で前号の有価証券の性質を有するもの

## 八 投資対象とする金融商品

前記「2 投資方針 (2) 投資対象 八 投資対象とする金融商品」において記載した三井住友D S・新興国株式インデックス・ファンドが投資対象とする金融商品に同じです。

## (3) 投資制限

## イ ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

- (イ) 株式への投資割合には制限を設けません。
- (ロ) 外貨建資産への投資割合には制限を設けません。
- (ハ) 投資信託証券(上場投資信託証券を除きます。)への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- (ニ) 同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- (ホ) 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
- (ヘ) デリバティブ取引(法人税法第61条の5に定めるものをいいます。)は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。
- (ト) 外国為替予約取引は、為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。

## (外国債券パッシブ・マザーファンド)

## (1) 投資方針等

## イ 基本方針

F T S E 世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース)をベンチマークとし、ベンチマークの動きと連動する投資成果を目指した運用を行います。

## ロ 投資態度

- (イ) F T S E 世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース)をベンチマークとし、ベンチマークの動きと連動する投資成果を目指します。

- (ロ) ポートフォリオ構築にあたっては、取引コストを極力抑えながら、推定トラッキングエラーを最小化します。
- (ハ) ベンチマークの月次の変化状況とポートフォリオのリスク量の状況を勘案しながらリバランスを行います。
- (ニ) 保有する外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行いません。
- (ホ) 公社債の組入比率は原則として高位を保ちます。
- (ヘ) 資金動向、市況動向等の急変により上記の運用が困難となった場合、暫定的に上記と異なる運用を行う場合があります。

## (2) 投資対象

### イ 投資対象とする資産の種類

前記「2 投資方針 (2) 投資対象 イ 投資対象とする資産の種類」において記載したベビーファンドが投資対象とする資産の種類に同じです。

### ロ 投資対象とする有価証券

委託会社は、信託金を、主として次の有価証券(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。)に投資することを指図します。

1. 株券または新株引受権証書
2. 国債証券
3. 地方債証券
4. 特別の法律により法人の発行する債券
5. 社債券(新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券(以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。))の新株引受権証券を除きます。)
6. 特定目的会社にかかる特定社債券(金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。)
7. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券(金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。)
8. 協同組織金融機関にかかる優先出資証券(金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。)
9. 特定目的会社にかかる優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券(金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。)
10. コマーシャル・ペーパー
11. 新株引受権証券(分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。))および新株予約権証券
12. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前各号の証券または証書の性質を有するもの
13. 投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。)
14. 投資証券または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)
15. 外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)
16. オプションを表示する証券または証書(金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。)
17. 預託証書(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)
18. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
19. 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)
20. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの

21. 外国の者に対する権利で前号の有価証券の性質を有するもの

#### 八 投資対象とする金融商品

前記「2 投資方針 (2) 投資対象 八 投資対象とする金融商品」において記載した三井住友DS・先進国債インデックス・ファンドが投資対象とする金融商品に同じです。

#### (3) 投資制限

##### イ ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

- (イ) 株式(新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。)への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。
- (ロ) 投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。
- (ハ) 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。
- (ニ) 同一発行体の発行する債券への投資割合は、国債を除き、信託財産の純資産総額の5%以内とします。
- (ホ) 同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。
- (ヘ) 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
- (ト) デリバティブ取引(法人税法第61条の5に定めるものをいいます。)は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。
- (チ) 外国為替予約取引は、為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。

#### (米ドル建て新興国債インデックス・マザーファンド)

##### (1) 投資方針等

##### イ 基本方針

JPMorgan・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス(円換算ベース)の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。

##### ロ 投資態度

- (イ) 主として米ドル建ての新興国の公社債に投資することにより、JPMorgan・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス(円換算ベース)の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。ただし、運用の効率性を勘案し、流動性の高い国、銘柄を中心に投資します。
- (ロ) 組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行いません。
- (ハ) 公社債の組入比率は、原則として高位を保ちます。
- (ニ) 資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。
- (ホ) デリバティブ取引(法人税法第61条の5で定めるものをいいます。)は、信託財産の資産または負債にかかる価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。
- (ヘ) 外国為替予約取引は、信託財産の資産または負債にかかる為替変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。

##### (2) 投資対象

##### イ 投資対象とする資産の種類

前記「2 投資方針 (2) 投資対象 イ 投資対象とする資産の種類」において記載した三井住友DS・新興国債インデックス・ファンドが投資対象とする資産の種類に同じです。

## ロ 投資対象とする有価証券

前記「2 投資方針（2）投資対象 ロ 投資対象とする有価証券」において記載した三井住友D S・新興国債インデックス・ファンドが投資対象とする有価証券の各号に掲げるものに投資します。

## ハ 投資対象とする金融商品

前記「2 投資方針（2）投資対象 ハ 投資対象とする金融商品」において記載した三井住友D S・新興国債インデックス・ファンドが投資対象とする金融商品に同じです。

## （3）投資制限

### イ ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

- （イ）株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- （ロ）外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。
- （ハ）投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- （ニ）一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

## （Jリート・インデックス・マザーファンド）

### （1）投資方針等

#### イ 基本方針

日本の取引所に上場（上場予定を含みます。）されている不動産投資信託（REIT）を主要投資対象とし、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保を目指して運用を行います。

#### ロ 投資態度

- （イ）東証REIT指数（配当込み）をベンチマークとし、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指します。
- （ロ）不動産投資信託（REIT）への投資にあたっては、東証REIT指数採用銘柄（採用予定を含みます。）に投資を行うものとします。
- （ハ）不動産投資信託（REIT）の組入比率は、原則として高位を保ちます。
- （ニ）東証REIT指数先物取引等を活用することがあります。このため不動産投資信託への投資総額と東証REIT指数先物取引等の買建玉の投資総額の合計額が信託財産の純資産総額を超えることがあります。
- （ホ）資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

### （2）投資対象

#### イ 投資対象とする資産の種類

前記「2 投資方針（2）投資対象 イ 投資対象とする資産の種類」において記載したベビーファンドが投資対象とする資産の種類に同じです。

#### ロ 投資対象とする有価証券

委託会社は、信託金を、主として次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。

- 1．国債証券、地方債証券、特別の法律により法人の発行する債券および社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券および短期社債等を除きます。）
- 2．コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等
- 3．外国または外国の者の発行する証券または証書で、前号の証券または証書の性質を有するも

の

4. 投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。)
5. 投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)
6. 外国法人が発行する譲渡性預金証書

#### 八 投資対象とする金融商品

前記「2 投資方針 (2) 投資対象 八 投資対象とする金融商品」において記載した三井住友DS・国内リートインデックス・ファンドが投資対象とする金融商品に同じです。

#### (3) 投資制限

イ ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

(イ) 投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。

(ロ) 株式への投資は行いません。

(ハ) 外貨建資産への投資は行いません。

(ニ) 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

(ホ) デリバティブ取引(法人税法第61条の5に定めるものをいいます。)は、価格変動リスクおよび金利変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。

#### (外国リート・インデックス・マザーファンド)

##### (1) 投資方針等

イ 基本方針

日本を除く世界各国の不動産投資信託(REIT)などを主要投資対象とし、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保を目指して運用を行います。

ロ 投資態度

(イ) S & P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、円換算ベース)をベンチマークとし、ベンチマークの動きに連動する投資成果を目指します。

(ロ) 不動産投資信託(REIT)などへの投資にあたっては、S & P先進国REIT指数(除く日本)採用銘柄(採用予定を含みます。)に投資を行うものとします。

(ハ) 不動産投資信託(REIT)の組入比率は、原則として高位を保ちます。

(ニ) 外貨建資産については、原則として対円で為替ヘッジを行わないものとします。

(ホ) 資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

##### (2) 投資対象

イ 投資対象とする資産の種類

前記「2 投資方針 (2) 投資対象 イ 投資対象とする資産の種類」において記載したベビーファンドが投資対象とする資産の種類に同じです(デリバティブ取引にかかる権利を除きます。)

ロ 投資対象とする有価証券

委託会社は、信託金を、主として次の有価証券(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。)に投資することを指図します。

1. 国債証券、地方債証券、特別の法律により法人の発行する債券および社債券(新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券および短期社債等を除きます。)

2. コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等

3. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前号の証券または証書の性質を有するも

の

4. 投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。)
5. 投資証券または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)
6. 外国法人が発行する譲渡性預金証書

#### ハ 投資対象とする金融商品

前記「2 投資方針 (2) 投資対象 ハ 投資対象とする金融商品」において記載した三井住友DS・先進国リートインデックス・ファンドが投資対象とする金融商品に同じです。

### (3) 投資制限

#### イ ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

- (イ) 投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。
- (ロ) 株式への投資は行いません。
- (ハ) 外貨建資産への投資割合には制限を設けません。
- (ニ) 一般社団法人投資信託協会規則に定める一のものに対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
- (ホ) 外国為替予約取引は、為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。

### (ゴールド・インデックス・マザーファンド)

#### (1) 投資方針等

##### イ 基本方針

L B M A 金価格(円換算ベース)の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。

##### ロ 投資態度

- (イ) 主として別に定める金地金価格との連動を目指す投資信託証券に投資することにより、ロンドン貴金属市場協会(L B M A)金価格(円換算ベース)の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。

別に定める金地金価格との連動を目指す投資信託証券は、継続的にモニタリングを行い、商品性及び運用上の効率性を損なわない範囲で、委託会社の判断により見直しを行うことがあります。

別に定める金地金価格との連動を目指す投資信託証券とは、下記のものとし、

iShares Gold Trust

SPDR Gold MiniShares Trust

- (ロ) 組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行いません。

- (ハ) 資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

#### (2) 投資対象

##### イ 投資対象とする資産の種類

前記「2 投資方針 (2) 投資対象 イ 投資対象とする資産の種類」において記載した三井住友DS・ゴールドインデックス・ファンド(為替ヘッジあり)が投資対象とする資産の種類に同じです。

##### ロ 投資対象とする有価証券

前記「2 投資方針 (2) 投資対象 ロ 投資対象とする有価証券」において記載した三井住友DS・ゴールドインデックス・ファンド(為替ヘッジあり)が投資対象とする有価証券の各号に掲げるものに投資します。



## 八 投資対象とする金融商品

前記「2 投資方針 (2) 投資対象 八 投資対象とする金融商品」において記載した三井住友DS・ゴールドインデックス・ファンド(為替ヘッジあり)が投資対象とする金融商品に同じです。

### (3) 投資制限

#### イ ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

(イ) 投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。

(ロ) 投資信託証券とコマーシャル・ペーパーおよび短期社債等以外の有価証券への投資は、買い現先取引または債券貸借取引に限ります。

(ハ) 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

(ニ) 同一銘柄の投資信託証券への投資割合には、原則として制限を設けません。ただし、当該投資信託証券が一般社団法人投資信託協会規則に定めるエクスポージャーがルックスルーできる場合に該当しないときは、当該投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。

(ホ) 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

## 3【投資リスク】

### イ ファンドのもつリスクの特性

当ファンドは、値動きのある有価証券等に投資しますので、基準価額は変動します。したがって、投資者の投資元本は保証されているものではなく、基準価額の下落により、損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。

運用の結果として信託財産に生じた利益および損失は、すべて投資者に帰属します。

投資信託は預貯金と異なります。また、一定の投資成果を保証するものではありません。

各ファンドの主要なリスクは以下の通りです。内容につきましては、後掲をご覧ください。

ファンド名	価格変動リスク				信用 リスク	為替変動リスク		カントリー リスク	流動性 リスク
	株式市場 リスク	債券市場 リスク	不動産 投資信託 (リート) に関する リスク	金に 関する リスク		為替 ヘッジ なし	為替 ヘッジ あり		
TOPIX-インデックス	●				●				●
225インデックス	●				●				●
先進国株インデックス	●				●	●		●	●
新興国株インデックス	●				●	●		●	●
先進国債インデックス		●			●	●		●	●
新興国債インデックス		●			●	●		●	●
Jリートインデックス			●		●				●
Gリートインデックス			●		●	●		●	●
ゴールドインデックス ヘッジ有				●	●		●	●	●

#### (イ) 株式市場リスク

内外の経済動向や株式市場での需給動向等の影響により株式相場が下落した場合、ファンドの基準価額が下落する要因となります。また、個々の株式の価格はその発行企業の事業活動や財務状況等によって変動し、株価が下落した場合はファンドの基準価額が下落する要因となります。

#### (ロ) 債券市場リスク

一般に債券は内外の経済情勢等の影響による金利の変動を受けて価格が変動します。通常、金利が上昇すると債券価格は下落します。また、格付けが引き下げられる場合も債券価格が下落するおそれがあります。債券価格の下落はファンドの基準価額が下落する要因となります。なお、価格の変動幅は、債券の種類、格付け、残存期間、利払いのしくみの違い等により、債券ごとに異なります。

#### (ハ) 不動産投資信託（リート）に関するリスク

リートの価格は、不動産市況や金利・景気動向、関連法制度の変更等の影響を受け変動します。また、リートに組み入れられている個々の不動産等の市場価値や賃貸収入、個々のリートの事業活動や財務状況等によっても価格が変動します。これらにより、ファンドが組み入れているリートの価格が下落した場合、ファンドの基準価額が下落する要因となります。

#### (ニ) 金に関するリスク

ファンドは金の指標価格に連動することを目指した上場投資信託証券に投資します。一般に、金価格は、金の需給の変化や為替・金利動向等の様々な要因の影響を受けて変動します。金価格が下落した場合、組入上場投資信託証券の価格も下がり、ファンドの基準価額が下落する要因となります。

#### (ホ) 信用リスク

ファンドが投資している有価証券や金融商品において債務不履行が発生あるいは懸念される場合、またはその発行体が経営不安や倒産等に陥った場合には、当該有価証券や金融商品の価格が下がったり、投資資金を回収できなくなったりすることがあります。これらはファンドの基準価額が下落する要因となります。

**（ヘ）為替変動リスク****（為替ヘッジなし）**

「ゴールドインデックスヘッジ有」以外

外貨建資産への投資は為替変動の影響を受けます。ファンドが保有する外貨建資産の価格が現地通貨ベースで上昇する場合であっても、当該現地通貨が対円で下落する（円高となる）場合、円ベースでの評価額が下落し、基準価額が下落することがあります。

**（為替ヘッジあり）**

「ゴールドインデックスヘッジ有」

外貨建資産への投資は為替変動の影響を受けますが、原則として対円での為替ヘッジを行うため、その影響は限定的と考えられます。ただし、完全に為替変動リスクを回避することはできません。なお、円金利がヘッジ対象通貨の金利よりも低い場合、その金利差相当分のヘッジコストがかかることにご留意ください。また、需給要因等によっては金利差相当分以上にヘッジコストがかかる場合があります。

**（ト）カントリーリスク**

海外に投資を行う場合には、投資先の国の政治・経済・社会状況の不安定化、取引規制や税制の変更等によって投資した資金の回収が困難になることや、その影響により投資する有価証券等の価格が大きく変動することがあり、基準価額が下落する要因となります。

特に投資先が新興国の場合、その証券市場は先進国の証券市場に比べ、より運用上の制約が大きいことが想定されます。また、先進国に比べ、一般に市場規模が小さいため、有価証券の需給変動の影響を受けやすく、価格形成が偏ったり、変動性が大きくなる傾向が考えられます。

**（チ）流動性リスク**

有価証券等を大量に売買しなければならない場合、あるいは市場を取り巻く外部環境に急激な変化があり、市場規模の縮小や市場の混乱が生じた場合等に、十分な数量の売買ができなかったり、通常よりも不利な価格での取引を余儀なくされることがあります。これらはファンドの基準価額が下落する要因となります。

**ロ その他の留意点****（イ）ファンド固有の留意点****a . 対象インデックスの動きと連動しない要因**

各ファンドは、特定の指数の動きに連動する投資成果を目指して運用を行いますが、以下の要因等により、各対象インデックスの動きに連動しないことがあります。

- ・ 有価証券売買時のコスト、信託報酬やその他のファンド運営にかかる費用を負担すること
- ・ 追加設定・一部解約により組入有価証券の売買のタイミング差が生じること
- ・ インデックス構成銘柄と組入有価証券との誤差が影響すること
- ・ 利用可能な指数先物と対象インデックスの動きに不一致が生じること
- ・ 「225インデックス」は、組入銘柄の配当金を受け取ること（対象インデックスは配当金を含まない指数です。）
- ・ 「ゴールドインデックスヘッジ有」は、金の指標価格と当該指標との連動を目指した上場投資信託証券の取引価格の動きに不一致が生じること

**b . 外国税制に関する留意点**

投資対象国によっては、有価証券の売買を行う際の売買益等に対して課税される場合があります。将来、これらの税率や課税方法が変更された場合、または新たな税制が適用された場合、基準価額に影響を及ぼすことがあります。

**（ロ）投資信託に関する留意点**

- ・ 当ファンドは「ファミリーファンド方式」により運用するため、当ファンドと同じマザーファンドを投資対象とする他のベビーファンドに追加設定・一部解約により資金の流出入が生じた場合、その結果として、当該マザーファンドにおいても組入有価証券の売買等が生じ、当ファンドの基準価額に影響を及ぼすことがあります。
- ・ ファンドのお申込みに関しては、クーリング・オフ制度の適用はありません。
- ・ ファンドは、大量の解約が発生し短期間で解約資金を手当てする必要が生じた場合や主たる

取引市場において市場環境が急変した場合等に、一時的に組入資産の流動性が低下し、市場実勢から期待できる価格で取引できないリスク、取引量が限られてしまうリスクがあります。

これにより、基準価額にマイナスの影響を及ぼす可能性、換金申込みの受け付けが中止となる可能性、既に受け付けた換金申込みが取り消しとなる可能性、換金代金のお支払いが遅延する可能性等があります。

#### (八) 分配金に関する留意事項

分配金は、預貯金の利息とは異なり、ファンドの純資産から支払われますので、分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。



分配金は、計算期間中に発生した収益（経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益）を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。

投資者のファンドの購入価額によっては、分配金の一部または全部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がりが小さかった場合も同様です。

#### 八 投資リスクの管理体制

委託会社では、運用部門から独立した組織を設置し、運用リスク管理を行っています。

リスク管理担当部は、信託約款等に定める各種投資制限やリスク指標のモニタリングを実施し、制限に対する抵触等があった場合には運用部門に対処要請等を行い、結果をリスク管理会議へ報告します。

また、ファンドのパフォーマンスの分析・評価を行い、結果を運用評価会議等へ報告することで、運用方針等との整合性を維持するよう適切に管理しています。

さらに、流動性リスク管理について規程を定め、ファンドの組入資産の流動性リスクのモニタリングやストレステストを実施するとともに、緊急時対応策等の策定や有効性の検証等を行います。なお、当該流動性リスクの適切な管理の実施等について、定期的にはリスク管理会議へ報告します。

コンプライアンス担当部は、法令・諸規則等の遵守状況の確認等を行い、結果をコンプライアンス会議に報告します。

## （参考情報）投資リスクの定量的比較

### ファンドの年間騰落率および 分配金再投資基準価額の推移

各月末におけるファンドの1年間の騰落率と分配金再投資基準価額の推移を表示したものです。

#### ■TOPIXインデックス（ベンチマーク:TOPIX(東証株価指数、配当込み)）



### ファンドと他の代表的な 資産クラスとの騰落率の比較

ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて、各月末における1年間の騰落率の平均・最大・最小を比較したものです。



#### ■225インデックス（ベンチマーク:日経平均株価(日経225)）



※年間騰落率、分配金再投資基準価額は、分配金(税引前)を分配時に再投資したものと仮定して計算したものです。

※分配実績がない場合は、分配金再投資基準価額は基準価額と同じです。

※ファンドの騰落率は、分配金(税引前)を分配時に再投資したものと仮定して計算しており、実際の基準価額をもとに計算したものと異なります。

※すべての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

### ファンドの年間騰落率および 分配金再投資基準価額の推移

各月末におけるファンドの1年間の騰落率と分配金再投資基準価額の推移を表示したものです。

### ■先進国株インデックス（ベンチマーク:MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円換算ベース)）



### ファンドと他の代表的な 資産クラスとの騰落率の比較

ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて、各月末における1年間の騰落率の平均・最大・最小を比較したものです。



### ■新興国株インデックス（ベンチマーク:MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円換算ベース)）



※年間騰落率、分配金再投資基準価額は、分配金(税引前)を分配時に再投資したものと仮定して計算したものです。

※分配実績がない場合は、分配金再投資基準価額は基準価額と同じです。

※ファンドの騰落率は、分配金(税引前)を分配時に再投資したものと仮定して計算しており、実際の基準価額をもとに計算したものと異なります。

※すべての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

## 【 ファンドの年間騰落率および 分配金再投資基準価額の推移 】

各月末におけるファンドの1年間の騰落率と分配金再投資基準価額の推移を表示したものです。

### ■先進国債インデックス（ベンチマーク:FTSE世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース））



## 【 ファンドと他の代表的な 資産クラスとの騰落率の比較 】

ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて、各月末における1年間の騰落率の平均・最大・最小を比較したものです。



### ■新興国債インデックス（ベンチマーク:JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（円換算ベース））



※年間騰落率、分配金再投資基準価額は、分配金（税引前）を分配時に再投資したものと仮定して計算したものです。  
※分配実績がない場合は、分配金再投資基準価額は基準価額と同じです。

※ファンドの騰落率は、分配金（税引前）を分配時に再投資したものと仮定して計算しており、実際の基準価額をもとに計算したものと異なります。  
※すべての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

## ファンドの年間騰落率および 分配金再投資基準価額の推移

各月末におけるファンドの1年間の騰落率と分配金再投資基準価額の推移を表示したものです。

### ■Jリートインデックス（ベンチマーク:東証REIT指数（配当込み））



## ファンドと他の代表的な 資産クラスとの騰落率の比較

ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて、各月末における1年間の騰落率の平均・最大・最小を比較したものです。

ファンド:  
2019年1月～2023年12月  
(2022年7月以前はベンチマークの騰落率)

他の資産クラス:  
2019年1月～2023年12月



### ■Gリートインデックス（ベンチマーク:S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース））



ファンド:  
2019年1月～2023年12月  
(2022年7月以前はベンチマークの騰落率)

他の資産クラス:  
2019年1月～2023年12月



※年間騰落率、分配金再投資基準価額は、分配金（税引前）を分配時に再投資したものと仮定して計算したものです。

※分配実績がない場合は、分配金再投資基準価額は基準価額と同じです。

※ファンドの騰落率は、分配金（税引前）を分配時に再投資したものと仮定して計算しており、実際の基準価額をもとに計算したものと異なります。

※すべての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。



### ファンドの年間騰落率および 分配金再投資基準価額の推移

各月末におけるファンドの1年間の騰落率と分配金再投資基準価額の推移を表示したものです。

### ■ ゴールドインデックスヘッジ有(ベンチマーク:LBMA金価格(円ヘッジ換算ベース))

年間騰落率:  
2019年1月~2023年12月  
(2022年7月以前はベンチマークの騰落率)

分配金再投資基準価額:  
2021年8月~2023年12月



※年間騰落率、分配金再投資基準価額は、分配金(税引前)を分配時に再投資したものと仮定して計算したものです。

※分配実績がない場合は、分配金再投資基準価額は基準価額と同じです。

### ファンドと他の代表的な 資産クラスとの騰落率の比較

ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて、各月末における1年間の騰落率の平均・最大・最小を比較したものです。

ファンド:  
2019年1月~2023年12月  
(2022年7月以前はベンチマークの騰落率)

他の資産クラス:  
2019年1月~2023年12月



※ファンドの騰落率は、分配金(税引前)を分配時に再投資したものと仮定して計算しており、実際の基準価額をもとに計算したものと異なります。

※すべての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

### 各資産クラスの指数

日本株	TOPIX(東証株価指数、配当込み) 株式会社J P X 総研または株式会社J P X 総研の関連会社が算出、公表する指数で、日本の株式を対象としています。
先進国株	MSCIコクサイ・インデックス(グロス配当込み、円ベース) MSCI Inc.が開発した指数で、日本を除く世界の主要先進国の株式を対象としています。
新興国株	MSCIエマージング・マーケット・インデックス(グロス配当込み、円ベース) MSCI Inc.が開発した指数で、新興国の株式を対象としています。
日本国債	NOMURA-BPI(国債) 野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社が公表する指数で、国内で発行された公募固定利付国債を対象としています。
先進国債	FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース) FTSE Fixed Income LLCにより運営されている指数で、日本を除く世界の主要国の国債を対象としています。
新興国債	JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス-エマージング・マーケット・グローバル・ダイバーシファイド(円ベース) J.P. Morganが算出、公表する指数で、新興国が発行する現地通貨建て国債を対象としています。

※海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円ベースとしています。

※上記各指数に関する知的所有権その他の一切の権利は、その発行者および許諾者に帰属します。また、上記各指数の発行者および許諾者は、当ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。

## 4【手数料等及び税金】

### (1)【申込手数料】

原則として、申込金額(取得申込受付日の翌営業日の基準価額×申込口数)に、1.1%(税抜き1.0%)を上限として、販売会社がそれぞれ別に定める申込手数料率を乗じて得た額となります。

申込手数料は販売会社によるファンドの募集・販売の取扱い事務等の対価です。

累積投資契約に基づく収益分配金の再投資の場合は無手数料となります。

申込手数料に関する詳細は、お申込みの販売会社にお問い合わせください。

### (2)【換金(解約)手数料】

解約手数料はありません。

### (3)【信託報酬等】

純資産総額に以下の率を乗じて得た金額が、毎日信託財産の費用として計上され、ファンドの基準価額に反映されます。また、信託報酬は、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日と各計算期末または信託終了のときに、信託財産中から支弁するものとします。

信託報酬の配分は以下の通りです。

< 信託報酬率およびその配分 >

ファンド名	信託報酬率	配分(税抜き)		
		委託会社	販売会社	受託会社
TOPIXインデックス 225インデックス	年0.385% (税抜き0.35%)	年0.165%	年0.165%	年0.02%
先進国株インデックス 新興国株インデックス	年0.473% (税抜き0.43%)	年0.205%	年0.205%	年0.02%
先進国債インデックス	年0.297% (税抜き0.27%)	年0.125%	年0.125%	年0.02%
新興国債インデックス	年0.473% (税抜き0.43%)	年0.205%	年0.205%	年0.02%
Jリートインデックス	年0.385% (税抜き0.35%)	年0.165%	年0.165%	年0.02%
Gリートインデックス	年0.473% (税抜き0.43%)	年0.205%	年0.205%	年0.02%
ゴールドインデックス ヘッジ有	年0.385% (税抜き0.35%)	年0.165%	年0.165%	年0.02%
マザーファンドが投資対象とする投資信託	年0.25%程度*			
実質的な負担	ファンドの純資産総額に対して年0.635%(税抜き0.60%)程度*			
<p>* 投資対象とする投資信託の運用管理費用は、管理費用が最大の投資信託の数値を用いています。なお、管理費用は、今後変更される場合があります。また、実際の組入状況等により実質的な負担も変動します。</p> <p>上記の料率は、2023年12月末現在で知り得る情報に基づくものであり、今後、変更される場合があります。</p> <p>投資対象とする投資信託の変更等に伴い、実質的な負担が変更となる場合があります。</p>				

上記の配分には別途消費税等相当額がかかります。

支払先	役務の内容
委託会社	ファンドの運用およびそれに伴う調査、受託会社への指図、基準価額の算出、法定書面等の作成等の対価
販売会社	交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
受託会社	ファンドの財産の保管および管理、委託会社からの指図の実行等の対価

#### (4) 【その他の手数料等】

- イ 信託財産の財務諸表の監査に要する費用(消費税等相当額を含みます。)は、原則として、計算期間を通じて毎日、信託財産の費用として計上され、「新興国債インデックス」および「ゴールドインデックスヘッジ有」は各計算期末または信託終了のときに、その他のファンドは毎計算期間の最初の6ヵ月終了日と各計算期末または信託終了のときに、信託財産中から支弁するものとします。
- ロ 信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用および受託会社の立て替えた立替金の利息は、信託財産中から支弁します。
- ハ 有価証券の売買時の手数料、デリバティブ取引等に要する費用、および外国における資産の保管

等に要する費用等(それらにかかる消費税等相当額を含みます。)は、信託財産中から支弁するものとします。

上記にかかる費用に関しましては、変更される場合があるものや、その時々取引内容等により金額が決定し、実務上、その発生もしくは請求のつど、信託財産の費用として認識され、その時点の信託財産で負担することとなるものがあります。したがって、あらかじめ、その金額、上限額等を具体的に記載することはできません。

リートを実質的な主要投資対象とするファンドでは、株式と同様に取引所等の市場で売買される多数の銘柄のリートの中から、約款上の選定基準に従って適宜組入銘柄を選定して分散投資を行い、また売却を行いますので、組み入れるリートの銘柄や構成比は流動的となります。

リートの多くは法人形態をとっており、その費用には、運用者等に支払う費用以外に、一般の会社と同じように多種多様なものがあり、また、国・地域によっては、開示する項目の基準が異なります。

したがって、委託会社において、ファンドが実質的に組み入れる様々なリートの費用等を網羅的に調査し、ファンドへの投資等のための参考になるような情報として、その上限額、計算方法等を具体的に記載することはできません。

上記(1)~(4)にかかる手数料等および投資対象のリートの組入れを通じて間接的に負担する手数料等の合計額、その上限額、計算方法等は、手数料等に保有期間に応じて異なるものが含まれていたり、発生時・請求時に初めて具体的な金額を認識するものがあったりすることから、あらかじめ具体的に記載することはできません。

#### (5)【課税上の取扱い】

##### イ 個別元本について

(イ) 追加型株式投資信託について、受益者毎の信託時の受益権の価額等(申込手数料および当該申込手数料にかかる消費税等相当額は含まれません。)が当該受益者の元本(個別元本)にあたります。

(ロ) 受益者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合、個別元本は、当該受益者が追加信託を行うつど当該受益者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。ただし、同一ファンドを複数の販売会社で取得する場合には、各販売会社毎に個別元本の算出が行われます。また、同一販売会社であっても同一受益者の顧客口座が複数存在する場合や、「分配金受取りコース」と「分配金自動再投資コース」を併用するファンドの場合には、別々に個別元本の算出が行われることがあります。

(ハ) 受益者が元本払戻金(特別分配金)を受け取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金(特別分配金)を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。(「元本払戻金(特別分配金)」については、下記の(収益分配金の課税について)を参照。)

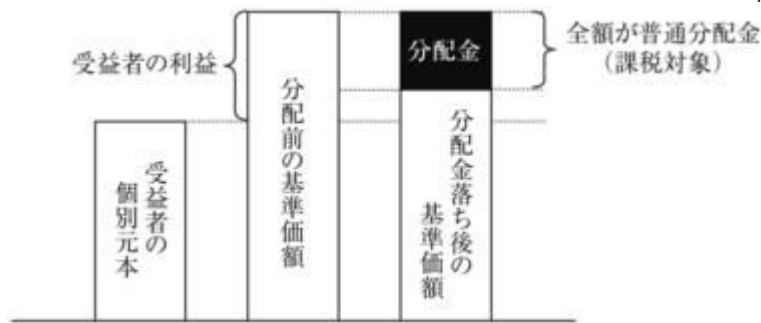
##### ロ 一部解約時および償還時の課税について

個人の受益者については、一部解約時および償還時の譲渡益が課税対象となり、法人の受益者については、一部解約時および償還時の個別元本超過額が課税対象となります。

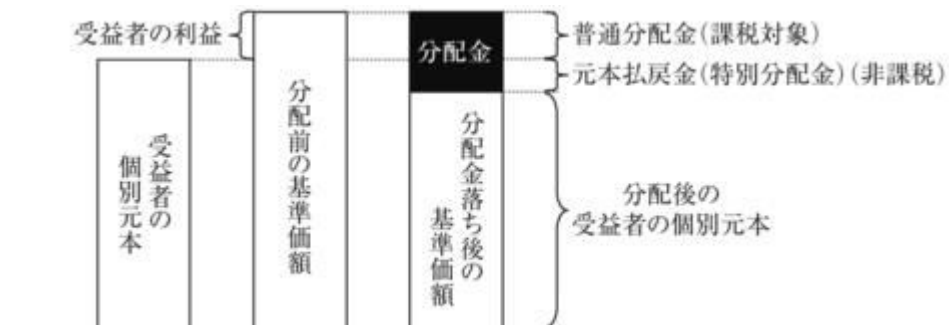
##### ハ 収益分配金の課税について

追加型株式投資信託の収益分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と、非課税扱いとなる「元本払戻金(特別分配金)」(受益者毎の元本の一部払戻しに相当する部分)の区分があります。

収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本と同額の場合または当該受益者の個別元本を上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となります。



収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本を下回っている場合には、その下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）となり、当該収益分配金から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が普通分配金となります。なお、受益者が元本払戻金（特別分配金）を受け取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。



上記、の図はあくまでもイメージ図であり、個別元本や基準価額、分配金の各水準等を示唆するものではありません。

## 二 個人、法人別の課税の取扱いについて

### (イ) 個人の受益者に対する課税

#### ・収益分配時

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金については、20.315%（所得税15.315%および地方税5%）の税率による源泉徴収が行われ、申告不要制度が適用されます。確定申告による総合課税または申告分離課税の選択も可能です。

#### ・一部解約時および償還時

一部解約時および償還時の譲渡益については、20.315%（所得税15.315%および地方税5%）の税率による申告分離課税が適用されます。ただし、特定口座（源泉徴収選択口座）の利用も可能です。

また、一部解約時および償還時の損失については、確定申告により、上場株式等（上場株式、公募株式投資信託、上場投資信託（ETF）、上場不動産投資信託（REIT）、公募公社債投資信託および特定公社債をいいます。以下同じ。）の譲渡益ならびに上場株式等の配当所得（申告分離課税を選択したものに限り、）および利子所得の金額との損益通算が可能です。

### (ロ) 法人の受益者に対する課税

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに一部解約時および償還時の個別元本超過額については、15.315%（所得税のみ）の税率で源泉徴収されます。

当ファンドは、課税上は株式投資信託として取り扱われます。

なお、「TOPIXインデックス」および「225インデックス」は、配当控除の適用が可能です。益金不算入制度の適用はありません。その他のファンドは、配当控除および益金不算入制度の適用はありません。

外国税額控除の適用となった場合には、分配時の税金が上記と異なる場合があります。

課税上の取扱いの詳細につきましては、税務専門家等に確認されることをお勧めいたします。

公募株式投資信託は税法上、一定の要件を満たした場合に限りNISA（少額投資非課税制度）の適用対象となります。

当ファンドは、NISAの「成長投資枠（特定非課税管理勘定）」の対象ですが、販売会社により取扱いが異なる場合があります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」をご利用の場合

少額投資非課税制度「NISA（ニーサ）」は、少額上場株式等に関する非課税制度であり、一定の額を上限として、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託等から生じる配当所得および譲渡所得が無期限で非課税となります。

ご利用になれるのは、販売会社で非課税口座を開設し、税法上の要件を満たした公募株式投資信託等を購入するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

上記「（5）課税上の取扱い」ほか税制に関する本書の記載は、2024年1月現在の情報をもとに作成しています。税法の改正等により、変更されることがあります。

### （参考情報）総経費率

直近の運用報告書の対象期間(2022年12月1日～2023年11月30日)における当ファンドの総経費率(年率換算)は以下の通りです。

	総経費率(①+②)	①運用管理費用の比率	②その他費用の比率
TOPIXインデックス	0.39%	0.38%	0.01%
225インデックス	0.39%	0.38%	0.01%
先進国株インデックス	0.51%	0.47%	0.04%
新興国株インデックス	0.58%	0.47%	0.11%
先進国債インデックス	0.34%	0.30%	0.04%
新興国債インデックス	0.49%	0.47%	0.02%
Jリートインデックス	0.39%	0.38%	0.01%
Gリートインデックス	0.53%	0.47%	0.05%
ゴールドインデックスヘッジ有	0.56%	0.38%	0.18%

※上記は、対象期間の運用報告書に記載されている総経費率(原則として、購入時手数料、売買委託手数料および有価証券取引税は含まれていません。)です。

※当ファンド(ゴールドインデックスヘッジ有を除く)が上場投資信託(ETF)および上場不動産投資信託(REIT)に投資している場合、当該ETFおよびREITの管理費用等は含まれていません。ゴールドインデックスヘッジ有は、投資しているETFの管理費用等は、その他費用に含めています。

※計算方法等の詳細は、対象期間の運用報告書(全体版)をご覧ください。なお、新たな対象期間にかかる運用報告書が作成され、上記の総経費率が更新されている場合があります。

運用報告書は、委託会社のホームページ(<https://www.smd-am.co.jp/fund/unpo/>)から検索いただけます。

## 5【運用状況】

### (1)【投資状況】

三井住友DS・TOPIXインデックス・ファンド

2023年12月29日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	日本	357,732,301	100.02
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	85,320	0.02

合計(純資産総額)	357,646,981	100.00
-----------	-------------	--------

(注) 投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。以下同じ。

### 三井住友D S・日経225インデックス・ファンド

2023年12月29日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	日本	504,976,287	100.03
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	152,694	0.03
合計(純資産総額)		504,823,593	100.00

### 三井住友D S・先進国株式インデックス・ファンド

2023年12月29日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	日本	942,224,934	100.03
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	320,511	0.03
合計(純資産総額)		941,904,423	100.00

### 三井住友D S・新興国株式インデックス・ファンド

2023年12月29日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	日本	134,719,927	100.04
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	48,257	0.04
合計(純資産総額)		134,671,670	100.00

### 三井住友D S・先進国債インデックス・ファンド

2023年12月29日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	日本	637,495,765	100.02
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	138,265	0.02
合計(純資産総額)		637,357,500	100.00

### 三井住友D S・新興国債インデックス・ファンド

2023年12月29日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	日本	54,753,402	99.03
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	538,740	0.97

合計(純資産総額)	55,292,142	100.00
-----------	------------	--------

## 三井住友D S・国内リートインデックス・ファンド

2023年12月29日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	日本	150,777,891	100.03
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	42,739	0.03
合計(純資産総額)		150,735,152	100.00

## 三井住友D S・先進国リートインデックス・ファンド

2023年12月29日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	日本	395,654,880	100.03
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	135,851	0.03
合計(純資産総額)		395,519,029	100.00

## 三井住友D S・ゴールドインデックス・ファンド(為替ヘッジあり)

2023年12月29日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	日本	947,995,156	99.17
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	7,918,284	0.83
合計(純資産総額)		955,913,440	100.00

その他以下の取引を行っております。

種類	買建/ 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率 (%)
為替予約取引	売建	-	919,178,163	96.16

## (2)【投資資産】

## 【投資有価証券の主要銘柄】

## 三井住友D S・TOPIXインデックス・ファンド

## イ 主要投資銘柄

2023年12月29日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資 信託受 益証券	国内株式イン デックス・マ ザーファンド (B号)	85,758,331	4.1671	357,364,296	4.1714	357,732,301	100.02

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

□ 種類別投資比率

2023年12月29日現在

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	100.02
合計	100.02

三井住友D S ・日経225インデックス・ファンド

イ 主要投資銘柄

2023年12月29日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資 信託受 益証券	225マザー ファンド	110,861,973	4.5506	504,487,250	4.5550	504,976,287	100.03

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

□ 種類別投資比率

2023年12月29日現在

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	100.03
合計	100.03

三井住友D S ・先進国株式インデックス・ファンド

イ 主要投資銘柄

2023年12月29日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資 信託受 益証券	外国株式イン デックス・マ ザーファンド	123,549,419	7.5040	927,113,849	7.6263	942,224,934	100.03

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

□ 種類別投資比率

2023年12月29日現在

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	100.03
合計	100.03

三井住友D S ・新興国株式インデックス・ファンド

イ 主要投資銘柄

2023年12月29日現在



国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資 信託受 益証券	エマージング株 式インデック ス・マザーファ ンド	72,892,505	1.8384	134,005,908	1.8482	134,719,927	100.04

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

□ 種類別投資比率

2023年12月29日現在

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	100.04
合計	100.04

三井住友DS・先進国債インデックス・ファンド

イ 主要投資銘柄

2023年12月29日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資 信託受 益証券	外国債券パッシ ブ・マザーファ ンド	293,993,620	2.1651	636,526,257	2.1684	637,495,765	100.02

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

□ 種類別投資比率

2023年12月29日現在

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	100.02
合計	100.02

三井住友DS・新興国債インデックス・ファンド

イ 主要投資銘柄

2023年12月29日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資 信託受 益証券	米ドル建て新興 国債インデック ス・マザーファ ンド	52,754,025	1.0305	54,363,040	1.0379	54,753,402	99.03

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

□ 種類別投資比率

2023年12月29日現在

種類	投資比率(%)
----	---------

親投資信託受益証券	99.03
合計	99.03

## 三井住友D S・国内リートインデックス・ファンド

## イ 主要投資銘柄

2023年12月29日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資 信託受 益証券	Jリート・イン デックス・マ ザーファンド	57,995,958	2.6371	152,941,133	2.5998	150,777,891	100.03

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

## ロ 種類別投資比率

2023年12月29日現在

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	100.03
合計	100.03

## 三井住友D S・先進国リートインデックス・ファンド

## イ 主要投資銘柄

2023年12月29日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資 信託受 益証券	外国リート・イ ンデックス・マ ザーファンド	124,053,076	2.9663	367,976,762	3.1894	395,654,880	100.03

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

## ロ 種類別投資比率

2023年12月29日現在

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	100.03
合計	100.03

## 三井住友D S・ゴールドインデックス・ファンド（為替ヘッジあり）

## イ 主要投資銘柄

2023年12月29日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資 信託受 益証券	ゴールド・イン デックス・マ ザーファンド	665,213,077	1.4591	970,631,369	1.4251	947,995,156	99.17

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

□ 種類別投資比率

2023年12月29日現在

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	99.17
合 計	99.17

【投資不動産物件】

三井住友D S ・ T O P I X インデックス・ファンド  
該当事項はありません。

三井住友D S ・ 日経 2 2 5 インデックス・ファンド  
該当事項はありません。

三井住友D S ・ 先進国株式インデックス・ファンド  
該当事項はありません。

三井住友D S ・ 新興国株式インデックス・ファンド  
該当事項はありません。

三井住友D S ・ 先進国債インデックス・ファンド  
該当事項はありません。

三井住友D S ・ 新興国債インデックス・ファンド  
該当事項はありません。

三井住友D S ・ 国内リートインデックス・ファンド  
該当事項はありません。

三井住友D S ・ 先進国リートインデックス・ファンド  
該当事項はありません。

三井住友D S ・ ゴールドインデックス・ファンド（為替ヘッジあり）  
該当事項はありません。

## 【その他投資資産の主要なもの】

三井住友D S・TOPIXインデックス・ファンド  
該当事項はありません。

三井住友D S・日経225インデックス・ファンド  
該当事項はありません。

三井住友D S・先進国株式インデックス・ファンド  
該当事項はありません。

三井住友D S・新興国株式インデックス・ファンド  
該当事項はありません。

三井住友D S・先進国債インデックス・ファンド  
該当事項はありません。

三井住友D S・新興国債インデックス・ファンド  
該当事項はありません。

三井住友D S・国内リートインデックス・ファンド  
該当事項はありません。

三井住友D S・先進国リートインデックス・ファンド  
該当事項はありません。

三井住友D S・ゴールドインデックス・ファンド（為替ヘッジあり）

2023年12月29日現在

種類	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約 取引	アメリカ・ドル	売建	6,514,000.00	926,897,013	919,178,163	96.16

（注）日本における対顧客先物相場の仲値で評価しております。

## （3）【運用実績】

## 【純資産の推移】

## 三井住友DS・TOPIXインデックス・ファンド

年月日	純資産総額 (円)		1万口当たりの 純資産額(円)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第1期 (2021年11月30日)	6,046,349	6,046,349	10,294	10,294
第2期 (2022年11月30日)	61,728,569	61,728,569	10,830	10,830
第3期 (2023年11月30日)	284,137,666	284,137,666	13,219	13,219
2022年12月末日	60,547,572	-	10,332	-
2023年 1月末日	79,728,160	-	10,783	-
2月末日	81,815,138	-	10,881	-
3月末日	104,935,888	-	11,061	-
4月末日	121,671,271	-	11,354	-
5月末日	130,501,091	-	11,760	-
6月末日	169,870,637	-	12,642	-
7月末日	178,987,235	-	12,826	-
8月末日	186,548,840	-	12,877	-
9月末日	229,617,619	-	12,938	-
10月末日	251,263,849	-	12,545	-
11月末日	284,137,666	-	13,219	-
12月末日	357,646,981	-	13,184	-

## 三井住友DS・日経225インデックス・ファンド

年月日	純資産総額 (円)		1万口当たりの 純資産額(円)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第1期 (2021年11月30日)	69,516,804	69,516,804	10,362	10,362
第2期 (2022年11月30日)	272,425,967	272,425,967	10,597	10,597
第3期 (2023年11月30日)	515,836,557	515,836,557	12,922	12,922
2022年12月末日	257,789,209	-	9,898	-
2023年 1月末日	269,323,406	-	10,361	-
2月末日	269,799,063	-	10,409	-
3月末日	287,815,631	-	10,735	-
4月末日	297,021,102	-	11,045	-
5月末日	298,879,557	-	11,829	-
6月末日	338,287,105	-	12,724	-
7月末日	342,549,115	-	12,713	-
8月末日	362,499,227	-	12,505	-
9月末日	364,836,387	-	12,297	-
10月末日	402,351,435	-	11,907	-
11月末日	515,836,557	-	12,922	-
12月末日	504,823,593	-	12,924	-

## 三井住友DS・先進国株式インデックス・ファンド

年月日	純資産総額 (円)		1万口当たりの 純資産額(円)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第1期 (2021年11月30日)	74,584,829	74,584,829	10,652	10,652
第2期 (2022年11月30日)	309,023,748	309,023,748	11,100	11,100
第3期 (2023年11月30日)	825,661,600	825,661,600	13,487	13,487
2022年12月末日	284,543,761	-	10,412	-
2023年 1月末日	324,401,618	-	10,799	-
2月末日	331,799,734	-	11,173	-
3月末日	363,770,293	-	11,111	-
4月末日	452,409,580	-	11,409	-
5月末日	507,297,860	-	11,936	-
6月末日	572,728,801	-	12,870	-
7月末日	617,867,476	-	13,059	-
8月末日	693,352,651	-	13,280	-
9月末日	738,870,445	-	12,953	-
10月末日	748,472,678	-	12,510	-
11月末日	825,661,600	-	13,487	-
12月末日	941,904,423	-	13,718	-

## 三井住友DS・新興国株式インデックス・ファンド

年月日	純資産総額 (円)		1万口当たりの 純資産額(円)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第1期 (2021年11月30日)	3,024,503	3,024,503	10,217	10,217
第2期 (2022年11月30日)	22,496,244	22,496,244	9,972	9,972
第3期 (2023年11月30日)	130,946,337	130,946,337	11,041	11,041
2022年12月末日	24,020,869	-	9,567	-
2023年 1月末日	26,133,711	-	10,231	-
2月末日	31,912,428	-	9,922	-
3月末日	31,316,112	-	9,936	-
4月末日	94,122,784	-	9,834	-
5月末日	98,920,896	-	10,249	-
6月末日	106,818,462	-	10,869	-
7月末日	121,854,881	-	11,227	-
8月末日	123,218,025	-	11,034	-
9月末日	122,764,142	-	10,790	-
10月末日	120,437,095	-	10,524	-
11月末日	130,946,337	-	11,041	-
12月末日	134,671,670	-	11,095	-

## 三井住友DS・先進国債インデックス・ファンド

年月日	純資産総額 (円)	1万口当たりの 純資産額(円)
-----	--------------	--------------------

	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第1期 (2021年11月30日)	6,787,059	6,787,059	10,037	10,037
第2期 (2022年11月30日)	80,135,860	80,135,860	10,037	10,037
第3期 (2023年11月30日)	568,449,519	568,449,519	10,827	10,827
2022年12月末日	79,902,505	-	9,542	-
2023年 1月末日	84,327,982	-	9,652	-
2月末日	191,756,225	-	9,759	-
3月末日	209,478,882	-	9,878	-
4月末日	281,851,611	-	9,944	-
5月末日	290,938,002	-	10,197	-
6月末日	313,919,144	-	10,599	-
7月末日	419,270,687	-	10,365	-
8月末日	497,493,351	-	10,642	-
9月末日	525,503,793	-	10,482	-
10月末日	532,051,706	-	10,466	-
11月末日	568,449,519	-	10,827	-
12月末日	637,357,500	-	10,836	-

## 三井住友DS・新興国債インデックス・ファンド

年月日	純資産総額 (円)		1万口当たりの 純資産額(円)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第1期 (2021年11月30日)	1,607,853	1,607,853	9,918	9,918
第2期 (2022年11月30日)	11,569,350	11,569,350	9,187	9,187
第3期 (2023年11月30日)	34,764,493	34,764,493	10,009	10,009
2022年12月末日	12,735,895	-	8,780	-
2023年 1月末日	13,254,529	-	8,840	-
2月末日	9,330,041	-	9,005	-
3月末日	14,448,431	-	9,019	-
4月末日	15,978,577	-	9,150	-
5月末日	10,699,855	-	9,386	-
6月末日	11,230,386	-	9,808	-
7月末日	21,729,071	-	9,639	-
8月末日	22,480,202	-	9,874	-
9月末日	27,284,847	-	9,720	-
10月末日	32,439,507	-	9,578	-
11月末日	34,764,493	-	10,009	-
12月末日	55,292,142	-	10,113	-

## 三井住友DS・国内リートインデックス・ファンド

年月日	純資産総額 (円)		1万口当たりの 純資産額(円)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第1期 (2021年11月30日)	2,142,283	2,142,283	9,513	9,513

第2期 (2022年11月30日)	118,055,864	118,055,864	9,600	9,600
第3期 (2023年11月30日)	143,043,924	143,043,924	9,353	9,353
2022年12月末日	129,503,608	-	9,259	-
2023年 1月末日	128,023,134	-	8,964	-
2月末日	131,891,486	-	9,102	-
3月末日	130,045,173	-	8,839	-
4月末日	144,748,985	-	9,286	-
5月末日	149,117,185	-	9,343	-
6月末日	150,397,161	-	9,283	-
7月末日	158,100,903	-	9,389	-
8月末日	166,736,646	-	9,525	-
9月末日	141,384,424	-	9,373	-
10月末日	141,005,628	-	9,178	-
11月末日	143,043,924	-	9,353	-
12月末日	150,735,152	-	9,197	-

## 三井住友DS・先進国リートインデックス・ファンド

年月日	純資産総額 (円)		1万口当たりの 純資産額(円)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第1期 (2021年11月30日)	2,304,754	2,304,754	10,763	10,763
第2期 (2022年11月30日)	86,933,845	86,933,845	10,597	10,597
第3期 (2023年11月30日)	344,098,319	344,098,319	11,071	11,071
2022年12月末日	72,935,232	-	9,934	-
2023年 1月末日	80,501,073	-	10,587	-
2月末日	68,062,862	-	10,696	-
3月末日	64,105,282	-	9,958	-
4月末日	122,103,502	-	10,177	-
5月末日	123,970,538	-	10,328	-
6月末日	340,026,656	-	11,061	-
7月末日	333,850,493	-	11,114	-
8月末日	340,274,324	-	11,278	-
9月末日	331,077,685	-	10,656	-
10月末日	313,325,199	-	10,056	-
11月末日	344,098,319	-	11,071	-
12月末日	395,519,029	-	11,943	-

## 三井住友DS・ゴールドインデックス・ファンド(為替ヘッジあり)

年月日	純資産総額 (円)		1万口当たりの 純資産額(円)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第1期 (2021年11月30日)	37,563,029	37,563,029	9,748	9,748
第2期 (2022年11月30日)	335,482,332	335,482,332	9,277	9,277
第3期 (2023年11月30日)	914,801,444	914,801,444	10,096	10,096



2022年12月末日	370,992,255	-	9,557	-
2023年 1月末日	433,118,317	-	10,039	-
2月末日	450,007,450	-	9,441	-
3月末日	497,083,038	-	10,230	-
4月末日	622,269,346	-	10,217	-
5月末日	678,039,843	-	10,025	-
6月末日	716,547,240	-	9,710	-
7月末日	765,267,550	-	9,913	-
8月末日	859,081,016	-	9,769	-
9月末日	858,590,122	-	9,339	-
10月末日	894,506,167	-	9,913	-
11月末日	914,801,444	-	10,096	-
12月末日	955,913,440	-	10,131	-

## 【分配の推移】

## 三井住友DS・TOPIXインデックス・ファンド

	計算期間	1万口当たり分配金(円)
第1期	2021年 8月23日～2021年11月30日	0
第2期	2021年12月 1日～2022年11月30日	0
第3期	2022年12月 1日～2023年11月30日	0

## 三井住友DS・日経225インデックス・ファンド

	計算期間	1万口当たり分配金(円)
第1期	2021年 8月23日～2021年11月30日	0
第2期	2021年12月 1日～2022年11月30日	0
第3期	2022年12月 1日～2023年11月30日	0

## 三井住友DS・先進国株式インデックス・ファンド

	計算期間	1万口当たり分配金(円)
第1期	2021年 8月23日～2021年11月30日	0
第2期	2021年12月 1日～2022年11月30日	0
第3期	2022年12月 1日～2023年11月30日	0

## 三井住友DS・新興国株式インデックス・ファンド

	計算期間	1万口当たり分配金(円)
第1期	2021年 8月23日～2021年11月30日	0
第2期	2021年12月 1日～2022年11月30日	0
第3期	2022年12月 1日～2023年11月30日	0

## 三井住友DS・先進国債インデックス・ファンド

	計算期間	1万口当たり分配金（円）
第1期	2021年 8月23日～2021年11月30日	0
第2期	2021年12月 1日～2022年11月30日	0
第3期	2022年12月 1日～2023年11月30日	0

## 三井住友D S・新興国債インデックス・ファンド

	計算期間	1万口当たり分配金（円）
第1期	2021年 8月23日～2021年11月30日	0
第2期	2021年12月 1日～2022年11月30日	0
第3期	2022年12月 1日～2023年11月30日	0

## 三井住友D S・国内リートインデックス・ファンド

	計算期間	1万口当たり分配金（円）
第1期	2021年 8月23日～2021年11月30日	0
第2期	2021年12月 1日～2022年11月30日	0
第3期	2022年12月 1日～2023年11月30日	0

## 三井住友D S・先進国リートインデックス・ファンド

	計算期間	1万口当たり分配金（円）
第1期	2021年 8月23日～2021年11月30日	0
第2期	2021年12月 1日～2022年11月30日	0
第3期	2022年12月 1日～2023年11月30日	0

## 三井住友D S・ゴールドインデックス・ファンド（為替ヘッジあり）

	計算期間	1万口当たり分配金（円）
第1期	2021年 8月23日～2021年11月30日	0
第2期	2021年12月 1日～2022年11月30日	0
第3期	2022年12月 1日～2023年11月30日	0

## 【収益率の推移】

## 三井住友D S・TOPIXインデックス・ファンド

	収益率（％）
第1期	2.9
第2期	5.2
第3期	22.1

（注）収益率とは、計算期間末の分配付基準価額から前期末分配落基準価額を控除した額を前期末分配落基準価額で除したものをいいます。

## 三井住友D S・日経225インデックス・ファンド

	収益率(%)
第1期	3.6
第2期	2.3
第3期	21.9

(注) 収益率とは、計算期間末の分配付基準価額から前期末分配落基準価額を控除した額を前期末分配落基準価額で除したものをいいます。

#### 三井住友D S・先進国株式インデックス・ファンド

	収益率(%)
第1期	6.5
第2期	4.2
第3期	21.5

(注) 収益率とは、計算期間末の分配付基準価額から前期末分配落基準価額を控除した額を前期末分配落基準価額で除したものをいいます。

#### 三井住友D S・新興国株式インデックス・ファンド

	収益率(%)
第1期	2.2
第2期	2.4
第3期	10.7

(注) 収益率とは、計算期間末の分配付基準価額から前期末分配落基準価額を控除した額を前期末分配落基準価額で除したものをいいます。

#### 三井住友D S・先進国債インデックス・ファンド

	収益率(%)
第1期	0.4
第2期	0.0
第3期	7.9

(注) 収益率とは、計算期間末の分配付基準価額から前期末分配落基準価額を控除した額を前期末分配落基準価額で除したものをいいます。

#### 三井住友D S・新興国債インデックス・ファンド

	収益率(%)
第1期	0.8
第2期	7.4
第3期	8.9

(注) 収益率とは、計算期間末の分配付基準価額から前期末分配落基準価額を控除した額を前期末分配落基準価額で除したものをいいます。

#### 三井住友D S・国内リートインデックス・ファンド

	収益率(%)

第1期	4.9
第2期	0.9
第3期	2.6

(注) 収益率とは、計算期間末の分配付基準価額から前期末分配落基準価額を控除した額を前期末分配落基準価額で除したものをいいます。

#### 三井住友DS・先進国リートインデックス・ファンド

	収益率(%)
第1期	7.6
第2期	1.5
第3期	4.5

(注) 収益率とは、計算期間末の分配付基準価額から前期末分配落基準価額を控除した額を前期末分配落基準価額で除したものをいいます。

#### 三井住友DS・ゴールドインデックス・ファンド(為替ヘッジあり)

	収益率(%)
第1期	2.5
第2期	4.8
第3期	8.8

(注) 収益率とは、計算期間末の分配付基準価額から前期末分配落基準価額を控除した額を前期末分配落基準価額で除したものをいいます。

#### (4) 【設定及び解約の実績】

#### 三井住友DS・TOPIXインデックス・ファンド

	設定口数(口)	解約口数(口)
第1期	11,131,313	5,257,925
第2期	52,125,564	1,000,000
第3期	190,811,491	32,871,325

(注) 本邦外における設定および解約の実績はありません。

#### 三井住友DS・日経225インデックス・ファンド

	設定口数(口)	解約口数(口)
第1期	68,267,713	1,179,562
第2期	221,907,962	31,922,134
第3期	233,724,846	91,595,580

(注) 本邦外における設定および解約の実績はありません。

#### 三井住友DS・先進国株式インデックス・ファンド

	設定口数(口)	解約口数(口)
第1期	72,990,426	2,971,998

第2期	270,552,214	62,163,465
第3期	476,514,487	142,749,153

(注) 本邦外における設定および解約の実績はありません。

#### 三井住友D S・新興国株式インデックス・ファンド

	設定口数(口)	解約口数(口)
第1期	2,960,151	0
第2期	29,976,495	10,377,413
第3期	107,220,605	11,184,925

(注) 本邦外における設定および解約の実績はありません。

#### 三井住友D S・先進国債インデックス・ファンド

	設定口数(口)	解約口数(口)
第1期	6,762,046	0
第2期	86,535,230	13,454,513
第3期	467,002,780	21,838,442

(注) 本邦外における設定および解約の実績はありません。

#### 三井住友D S・新興国債インデックス・ファンド

	設定口数(口)	解約口数(口)
第1期	1,621,093	0
第2期	10,979,714	8,229
第3期	35,198,756	13,056,970

(注) 本邦外における設定および解約の実績はありません。

#### 三井住友D S・国内リートインデックス・ファンド

	設定口数(口)	解約口数(口)
第1期	2,350,609	98,727
第2期	132,574,732	11,855,664
第3期	67,492,161	37,529,664

(注) 本邦外における設定および解約の実績はありません。

#### 三井住友D S・先進国リートインデックス・ファンド

	設定口数(口)	解約口数(口)
第1期	2,141,454	0
第2期	90,161,002	10,267,851
第3期	282,784,981	54,000,313

(注) 本邦外における設定および解約の実績はありません。

#### 三井住友D S・ゴールドインデックス・ファンド(為替ヘッジあり)

	設定口数（口）	解約口数（口）
第1期	38,535,757	0
第2期	379,344,235	56,234,121
第3期	701,752,986	157,283,244

（注）本邦外における設定および解約の実績はありません。

（参考）

（1）投資状況

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

2023年12月29日現在

資産の種類	国／地域	時価合計 （円）	投資比率 （％）
株式	日本	280,433,983,340	98.85
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	3,266,393,368	1.15
合計（純資産総額）		283,700,376,708	100.00

その他以下の取引を行っております。

種類	買建/ 売建	国／地域	時価合計（円）	投資比率 （％）
株価指数先物取引	買建	日本	3,217,760,000	1.13
合計	買建	-	3,217,760,000	1.13

2.2.5 マザーファンド

2023年12月29日現在

資産の種類	国／地域	時価合計 （円）	投資比率 （％）
株式	日本	153,750,696,030	98.58
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	2,209,407,157	1.42
合計（純資産総額）		155,960,103,187	100.00

その他以下の取引を行っております。

種類	買建/ 売建	国／地域	時価合計（円）	投資比率 （％）
株価指数先物取引	買建	日本	2,207,700,000	1.42
合計	買建	-	2,207,700,000	1.42

外国株式インデックス・マザーファンド

2023年12月29日現在

資産の種類	国／地域	時価合計 （円）	投資比率 （％）
株式	アメリカ	427,642,150,761	68.34
	イギリス	23,737,025,831	3.79
	カナダ	21,076,797,081	3.37
	スイス	19,342,298,452	3.09
	フランス	19,151,405,342	3.06
	ドイツ	14,846,992,161	2.37
	オーストラリア	11,869,252,066	1.90
	オランダ	11,763,206,016	1.88
	アイルランド	11,103,478,850	1.77

	デンマーク	5,839,453,849	0.93
	スウェーデン	5,627,774,297	0.90
	スペイン	4,505,145,433	0.72
	イタリア	3,397,528,817	0.54
	香港	2,813,545,742	0.45
	ジャージー	2,048,492,795	0.33
	シンガポール	1,920,301,594	0.31
	フィンランド	1,892,346,050	0.30
	ベルギー	1,347,076,920	0.22
	イスラエル	1,200,524,260	0.19
	ノルウェー	1,165,500,815	0.19
	ケイマン諸島	870,086,095	0.14
	オランダ領キュラソー	816,175,156	0.13
	バミューダ	781,696,841	0.12
	ニュージーランド	479,378,262	0.08
	リベリア	354,552,729	0.06
	ルクセンブルグ	326,213,884	0.05
	オーストリア	325,907,460	0.05
	ポルトガル	309,335,945	0.05
	パナマ	184,682,395	0.03
	マン島	75,896,858	0.01
	小計	596,814,222,757	95.37
投資証券	アメリカ	11,005,703,671	1.76
	オーストラリア	1,149,163,052	0.18
	フランス	238,044,863	0.04
	シンガポール	232,391,282	0.04
	イギリス	222,164,565	0.04
	香港	150,739,198	0.02
	ベルギー	60,548,542	0.01
	カナダ	57,572,007	0.01
	ケイマン諸島	46,186,668	0.01
	小計	13,162,513,848	2.10
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	15,822,113,327	2.53
合計（純資産総額）		625,798,849,932	100.00

その他以下の取引を行っております。

種類	買建 / 売建	国 / 地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引	買建	イギリス	657,744,761	0.11
株価指数先物取引	買建	ドイツ	2,299,435,488	0.37
株価指数先物取引	買建	アメリカ	12,199,372,711	1.95
株価指数先物取引	買建	オーストラリア	516,195,806	0.08
合計	買建	-	15,672,748,766	2.50

種類	買建 / 売建	国 / 地域	時価合計（円）	投資比率（％）
----	---------	--------	---------	---------

為替予約取引	買建	-	2,351,884,607	0.38
--------	----	---	---------------	------

## エマージング株式インデックス・マザーファンド

2023年12月29日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株式	インド	5,930,451,379	15.60
	台湾	5,467,847,934	14.38
	ケイマン諸島	5,321,352,795	14.00
	韓国	4,567,504,281	12.01
	中国	2,075,416,673	5.46
	ブラジル	1,951,402,282	5.13
	南アフリカ	973,317,208	2.56
	メキシコ	713,955,104	1.88
	インドネシア	663,834,948	1.75
	タイ	614,675,632	1.62
	マレーシア	467,661,332	1.23
	香港	324,687,077	0.85
	ポーランド	318,580,121	0.84
	フィリピン	217,454,000	0.57
	トルコ	216,197,875	0.57
	チリ	178,949,490	0.47
	ギリシャ	166,864,412	0.44
	バミューダ	144,211,903	0.38
	アメリカ	123,557,360	0.33
	ハンガリー	90,358,911	0.24
	チェコ	53,190,691	0.14
	イギリス	41,324,735	0.11
	ルクセンブルグ	39,148,000	0.10
	コロンビア	37,087,983	0.10
	エジプト	36,867,408	0.10
	オランダ	21,378,661	0.06
ペルー	16,136,580	0.04	
シンガポール	6,476,827	0.02	
	小計	30,779,891,602	80.96
投資信託受益証券	香港	1,538,800,592	4.05
投資証券	アメリカ	2,456,277,082	6.46
	メキシコ	249,305,346	0.66
	ブラジル	85,155,118	0.22
	小計	2,790,737,546	7.34
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	2,907,485,419	7.65
合計（純資産総額）		38,016,915,159	100.00

その他以下の取引を行っております。

種類	買建/ 売建	国/地域	時価合計（円）	投資比率 (%)
株価指数先物取引	買建	アメリカ	2,936,680,212	7.72



合計	買建	-	2,936,680,212	7.72
----	----	---	---------------	------

種類	買建 / 売建	国 / 地域	時価合計(円)	投資比率(%)
為替予約取引	買建	-	101,524,652	0.27

## 外国債券パッシブ・マザーファンド

2023年12月29日現在

資産の種類	国 / 地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	アメリカ	78,943,633,045	46.19
	フランス	14,326,733,451	8.38
	イタリア	12,823,364,684	7.50
	中国	12,600,552,150	7.37
	ドイツ	11,208,492,065	6.56
	イギリス	8,921,070,121	5.22
	スペイン	8,340,206,524	4.88
	カナダ	3,378,829,597	1.98
	ベルギー	3,068,313,756	1.80
	オランダ	2,619,343,749	1.53
	オーストラリア	2,419,761,363	1.42
	オーストリア	2,037,254,528	1.19
	メキシコ	1,530,648,693	0.90
	アイルランド	963,930,728	0.56
	ポーランド	869,157,251	0.51
	フィンランド	865,848,725	0.51
	マレーシア	857,928,610	0.50
	シンガポール	728,648,514	0.43
	イスラエル	532,106,447	0.31
	デンマーク	475,296,072	0.28
ニュージーランド	404,024,637	0.24	
スウェーデン	356,682,164	0.21	
ノルウェー	297,515,097	0.17	
小計		168,569,341,971	98.63
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	2,343,084,323	1.37
合計(純資産総額)		170,912,426,294	100.00

## 米ドル建て新興国債インデックス・マザーファンド

2023年12月29日現在

資産の種類	国 / 地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	メキシコ	687,027,214	9.97
	トルコ	659,499,855	9.57
	サウジアラビア	649,258,311	9.42
	ブラジル	541,515,733	7.86

	アラブ首長国連邦	482,873,425	7.01
	コロンビア	426,305,806	6.19
	チリ	420,586,369	6.10
	カタール	420,049,826	6.09
	ドミニカ共和国	418,833,492	6.08
	パナマ	282,721,510	4.10
	オマーン	267,652,782	3.88
	ペルー	266,708,478	3.87
	インドネシア	217,413,476	3.15
	ハンガリー	208,232,536	3.02
	中国	201,681,267	2.93
	南アフリカ	201,405,691	2.92
	ウルグアイ	157,994,223	2.29
	フィリピン	109,976,683	1.60
	小計	6,619,736,677	96.05
	現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	272,311,038
	合計(純資産総額)	6,892,047,715	100.00

その他以下の取引を行っております。

種類	買建/ 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率 (%)
為替予約取引	買建	-	59,511,690	0.86

#### Jリート・インデックス・マザーファンド

2023年12月29日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
投資証券	日本	12,519,481,800	98.67
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	168,345,301	1.33
合計(純資産総額)		12,687,827,101	100.00

その他以下の取引を行っております。

種類	買建/ 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率 (%)
リート指数先物取引	買建	日本	35,760,000	0.28
合計	買建	-	35,760,000	0.28

#### 外国リート・インデックス・マザーファンド

2023年12月29日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
投資証券	アメリカ	24,930,098,909	75.55
	オーストラリア	2,188,324,457	6.63
	イギリス	1,571,652,530	4.76
	シンガポール	1,103,027,857	3.34
	フランス	588,971,439	1.78
	カナダ	482,967,289	1.46
	香港	388,602,299	1.18

	ベルギー	367,303,397	1.11
	スペイン	137,270,323	0.42
	ニュージーランド	94,111,849	0.29
	ガーンジー	77,312,164	0.23
	オランダ	58,082,572	0.18
	韓国	55,546,216	0.17
	イスラエル	38,286,243	0.12
	ドイツ	12,939,796	0.04
	アイルランド	10,876,210	0.03
	イタリア	2,857,092	0.01
	小計	32,108,230,642	97.31
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	887,761,455	2.69
合計(純資産総額)		32,995,992,097	100.00

その他以下の取引を行っております。

種類	買建/ 売建	国/地域	時価合計(円)	投資比率 (%)
為替予約取引	買建	-	76,690,945	0.23

## ゴールド・インデックス・マザーファンド

2023年12月29日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
投資信託受益証券	アメリカ	7,765,729,170	96.73
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	262,189,702	3.27
合計(純資産総額)		8,027,918,872	100.00

## (2) 投資資産

投資有価証券の主要銘柄

### 国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

#### イ 主要投資銘柄(上位30銘柄)

2023年12月29日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	4,583,400	2,791.74	12,795,649,500	2,590.50	11,873,297,700	4.19
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	590,900	12,827.42	7,579,724,000	13,410.00	7,923,969,000	2.79
日本	株式	三菱UFJ フィナンシャル・グループ	銀行業	5,031,400	1,255.00	6,314,407,000	1,211.50	6,095,541,100	2.15
日本	株式	キーエンス	電気機器	83,500	63,342.53	5,289,101,300	62,120.00	5,187,020,000	1.83
日本	株式	信越化学工業	化学	758,200	5,223.19	3,960,224,600	5,917.00	4,486,269,400	1.58
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	177,000	24,049.01	4,256,674,800	25,255.00	4,470,135,000	1.58
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	24,885,900	173.09	4,307,379,800	172.30	4,287,840,570	1.51
日本	株式	日立製作所	電気機器	405,600	10,283.19	4,170,862,400	10,170.00	4,124,952,000	1.45

日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	584,500	7,252.48	4,239,076,000	6,880.00	4,021,360,000	1.42
日本	株式	三菱商事	卸売業	1,749,900	2,294.28	4,014,762,400	2,253.50	3,943,399,650	1.39
日本	株式	任天堂	その他製品	527,100	6,914.04	3,644,388,000	7,359.00	3,878,928,900	1.37
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	636,100	5,511.38	3,505,788,600	5,963.00	3,793,064,300	1.34
日本	株式	三井物産	卸売業	665,500	5,390.48	3,587,365,900	5,298.00	3,525,819,000	1.24
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	593,300	5,739.50	3,405,248,200	5,767.00	3,421,561,100	1.21
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	743,800	4,162.53	3,096,091,000	4,054.00	3,015,365,200	1.06
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	2,033,500	1,508.33	3,067,188,500	1,466.00	2,981,111,000	1.05
日本	株式	KDDI	情報・通信業	646,100	4,622.87	2,986,838,400	4,486.00	2,898,404,600	1.02
日本	株式	HOYA	精密機器	164,300	16,666.85	2,738,363,100	17,625.00	2,895,787,500	1.02
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	809,000	3,646.64	2,950,129,800	3,529.00	2,854,961,000	1.01
日本	株式	第一三共	医薬品	730,700	3,998.20	2,921,481,600	3,872.00	2,829,270,400	1.00
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	1,108,400	2,511.63	2,783,885,400	2,412.50	2,674,015,000	0.94
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	413,400	6,027.07	2,491,591,000	6,293.00	2,601,526,200	0.92
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	454,900	5,028.27	2,287,359,300	5,251.00	2,388,679,900	0.84
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	1,342,700	1,797.77	2,413,869,000	1,759.50	2,362,480,650	0.83
日本	株式	ダイキン工業	機械	100,600	22,163.95	2,229,693,200	22,985.00	2,312,291,000	0.82
日本	株式	村田製作所	電気機器	759,700	2,884.56	2,191,399,950	2,993.00	2,273,782,100	0.80
日本	株式	S M C	機械	25,200	74,450.00	1,876,140,000	75,760.00	1,909,152,000	0.67
日本	株式	三菱電機	電気機器	939,100	2,009.42	1,887,044,600	1,999.00	1,877,260,900	0.66
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	499,800	3,800.12	1,899,298,200	3,645.00	1,821,771,000	0.64
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	304,400	5,496.38	1,673,098,000	5,595.00	1,703,118,000	0.60

□ 種類別・業種別投資比率

2023年12月29日現在

種類	業種	投資比率(%)
株式(国内)	水産・農林業	0.08
	鉱業	0.34
	建設業	2.09
	食料品	3.33
	繊維製品	0.40
	パルプ・紙	0.17
	化学	6.12
	医薬品	4.57
	石油・石炭製品	0.46

ゴム製品	0.69
ガラス・土石製品	0.67
鉄鋼	0.95
非鉄金属	0.67
金属製品	0.52
機械	5.27
電気機器	17.35
輸送用機器	8.09
精密機器	2.34
その他製品	2.35
電気・ガス業	1.39
陸運業	2.81
海運業	0.83
空運業	0.44
倉庫・運輸関連業	0.14
情報・通信業	7.64
卸売業	6.92
小売業	4.25
銀行業	6.80
証券、商品先物取引業	0.80
保険業	2.35
その他金融業	1.14
不動産業	1.93
サービス業	4.94
合計	98.85

## 2 2 5 マザーファンド

## イ 主要投資銘柄(上位30銘柄)

2023年12月29日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
日本	株式	ファーストリ テイリング	小売業	459,000	35,583.92	16,333,017,780	34,990.00	16,060,410,000	10.30
日本	株式	東京エレクト ロン	電気機 器	459,000	22,227.32	10,202,340,660	25,255.00	11,592,045,000	7.43
日本	株式	アドバンテス ト	電気機 器	1,224,000	4,248.88	5,200,625,600	4,797.00	5,871,528,000	3.76
日本	株式	ソフトバンク グループ	情報・ 通信業	918,000	5,792.37	5,317,394,880	6,293.00	5,776,974,000	3.70
日本	株式	信越化学工業	化学	765,000	4,851.45	3,711,355,700	5,917.00	4,526,505,000	2.90
日本	株式	K D D I	情報・ 通信業	918,000	4,618.97	4,240,211,760	4,486.00	4,118,148,000	2.64
日本	株式	ダイキン工業	機械	153,000	23,093.03	3,533,233,280	22,985.00	3,516,705,000	2.25
日本	株式	ファナック	電気機 器	765,000	3,885.78	2,972,621,300	4,147.00	3,172,455,000	2.03
日本	株式	T D K	電気機 器	459,000	6,159.73	2,827,316,520	6,717.00	3,083,103,000	1.98

日本	株式	テルモ	精密機器	612,000	4,204.16	2,572,946,400	4,622.00	2,828,664,000	1.81
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	459,000	4,620.44	2,120,781,840	5,963.00	2,737,017,000	1.75
日本	株式	京セラ	電気機器	1,224,000	1,981.14	2,424,913,040	2,058.00	2,518,992,000	1.62
日本	株式	中外製薬	医薬品	459,000	4,694.87	2,154,946,020	5,342.00	2,451,978,000	1.57
日本	株式	レーザーテック	電気機器	61,200	29,234.49	1,789,151,088	37,170.00	2,274,804,000	1.46
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	153,000	12,962.79	1,983,306,980	13,410.00	2,051,730,000	1.32
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	765,000	2,799.47	2,141,597,800	2,590.50	1,981,732,500	1.27
日本	株式	第一三共	医薬品	459,000	4,057.61	1,862,440,800	3,872.00	1,777,248,000	1.14
日本	株式	日東電工	化学	153,000	10,337.98	1,581,711,000	10,550.00	1,614,150,000	1.03
日本	株式	セコム	サービス業	153,000	10,576.37	1,618,184,320	10,155.00	1,553,715,000	1.00
日本	株式	NTTデータグループ	情報・通信業	765,000	1,846.92	1,412,892,600	1,999.00	1,529,235,000	0.98
日本	株式	HOYA	精密機器	76,500	15,339.05	1,173,437,630	17,625.00	1,348,312,500	0.86
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	918,000	1,582.58	1,452,804,840	1,466.00	1,345,788,000	0.86
日本	株式	キッコーマン	食料品	153,000	9,681.70	1,481,300,380	8,634.00	1,321,002,000	0.85
日本	株式	デンソー	輸送用機器	612,000	2,369.51	1,450,139,678	2,127.00	1,301,724,000	0.83
日本	株式	バンダイナムコホールディングス	その他製品	459,000	3,009.93	1,381,559,040	2,826.50	1,297,363,500	0.83
日本	株式	富士フイルムホールディングス	化学	153,000	8,499.39	1,300,405,960	8,473.00	1,296,369,000	0.83
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	765,000	1,788.29	1,368,043,700	1,686.00	1,289,790,000	0.83
日本	株式	豊田通商	卸売業	153,000	8,644.25	1,322,570,100	8,308.00	1,271,124,000	0.82
日本	株式	オリンパス	精密機器	612,000	2,046.28	1,252,325,440	2,040.50	1,248,786,000	0.80
日本	株式	S M C	機械	15,300	76,229.51	1,166,311,510	75,760.00	1,159,128,000	0.74

□ 種類別・業種別投資比率

2023年12月29日現在

種類	業種	投資比率(%)
株式(国内)	水産・農林業	0.07
	鉱業	0.07
	建設業	1.65
	食料品	3.42
	繊維製品	0.10
	パルプ・紙	0.07
	化学	6.96
	医薬品	6.09

石油・石炭製品	0.21
ゴム製品	0.73
ガラス・土石製品	0.70
鉄鋼	0.08
非鉄金属	0.68
金属製品	0.02
機械	4.82
電気機器	26.63
輸送用機器	4.44
精密機器	3.70
その他製品	2.27
電気・ガス業	0.16
陸運業	1.33
海運業	0.44
空運業	0.30
倉庫・運輸関連業	0.21
情報・通信業	9.96
卸売業	3.12
小売業	12.25
銀行業	0.65
証券、商品先物取引業	0.16
保険業	0.89
その他金融業	0.81
不動産業	1.13
サービス業	4.47
合計	98.58

## 外国株式インデックス・マザーファンド

## イ 主要投資銘柄（上位30銘柄）

2023年12月29日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
アメリカ	株式	APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	1,186,701	26,858.91	31,873,489,509	27,455.45	32,581,411,631	5.21
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	535,782	53,732.41	28,788,857,995	53,225.96	28,517,512,586	4.56

アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	一般消費財・サービス流通・小売り	705,299	20,751.96	14,636,339,326	21,753.89	15,342,993,618	2.45
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	187,638	68,250.76	12,806,435,837	70,237.05	13,179,140,075	2.11
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	450,095	19,141.86	8,615,657,390	19,888.82	8,951,858,842	1.43
アメリカ	株式	META PLATFORMS INC-CLASS A	メディア・娯楽	168,973	47,102.76	7,959,095,466	50,820.53	8,587,296,672	1.37
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	396,590	19,345.61	7,672,276,263	20,037.74	7,946,768,258	1.27
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	216,710	34,619.83	7,502,462,784	35,908.52	7,781,735,239	1.24
アメリカ	株式	BROADCOM INC	半導体・半導体製造装置	33,796	133,402.05	4,508,455,835	159,191.41	5,380,032,902	0.86
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	219,809	21,887.21	4,811,004,775	24,153.65	5,309,189,433	0.85
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	70,499	75,893.67	5,350,428,136	74,446.57	5,248,408,526	0.84
アメリカ	株式	ELI LILLY & CO	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	61,421	83,942.14	5,155,810,314	82,381.96	5,059,982,088	0.81
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	金融サービス	99,574	50,877.62	5,066,087,701	50,714.15	5,049,811,080	0.81
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	金融サービス	121,762	36,057.44	4,390,426,118	36,932.53	4,496,978,961	0.72
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	エネルギー	303,917	14,515.58	4,411,532,808	14,209.95	4,318,644,675	0.69



アメリカ	株式	JOHNSON & JOHNSON	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	182,679	21,578.20	3,941,883,660	22,207.74	4,056,887,991	0.65
アメリカ	株式	MASTERCARD INC - A	金融サービス	63,944	58,132.63	3,717,232,941	60,464.97	3,866,371,760	0.62
アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	一般消費財・サービス流通・小売り	76,259	44,117.30	3,364,340,972	49,266.07	3,756,981,140	0.60
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO/THE	家庭用品・パーソナル用品	179,605	21,438.91	3,850,534,931	20,668.89	3,712,235,252	0.59
デンマーク	株式	NOVO NORDISK A/S-B	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	248,345	14,533.99	3,609,444,678	14,718.06	3,655,155,617	0.58
スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品・飲料・タバコ	203,555	16,678.27	3,394,945,093	16,283.95	3,314,679,360	0.53
オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・半導体製造装置	30,583	98,848.12	3,023,072,125	107,768.61	3,295,887,338	0.53
アメリカ	株式	COSTCO WHOLESALE CORP	生活必需品流通・小売り	33,432	83,376.18	2,787,432,576	94,047.47	3,144,195,117	0.50
アメリカ	株式	MERCK & CO. INC.	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	191,252	14,343.27	2,743,178,672	15,426.85	2,950,415,744	0.47
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	138,241	20,410.20	2,821,525,876	21,241.88	2,936,498,608	0.47

アメリカ	株式	ADOBE INC	ソフトウェア・サービス	34,737	87,547.25	3,041,128,982	84,462.60	2,933,977,391	0.47
アメリカ	株式	ABBVIE INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	133,033	19,643.46	2,613,227,749	21,948.19	2,919,833,892	0.47
アメリカ	株式	SALESFORCE INC	ソフトウェア・サービス	73,560	32,670.54	2,403,244,959	37,667.21	2,770,800,070	0.44
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	541,247	4,298.87	2,326,749,029	4,805.20	2,600,800,300	0.42
アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲料・タバコ	309,873	8,258.76	2,559,167,016	8,332.51	2,582,020,645	0.41

□ 種別・業種別投資比率

2023年12月29日現在

種類	業種	投資比率（％）
株式（外国）	エネルギー	4.58
	素材	3.98
	資本財	6.77
	商業・専門サービス	1.55
	運輸	1.75
	自動車・自動車部品	2.03
	耐久消費財・アパレル	1.52
	消費者サービス	2.05
	一般消費財・サービス流通・小売り	4.53
	生活必需品流通・小売り	1.67
	食品・飲料・タバコ	3.45
	家庭用品・パーソナル用品	1.59
	ヘルスケア機器・サービス	4.26
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.76
	銀行	5.35
	金融サービス	6.61
	保険	2.98
	ソフトウェア・サービス	9.87
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	6.60
半導体・半導体製造装置	6.49	
電気通信サービス	1.13	

	公益事業	2.62
	メディア・娯楽	5.87
	不動産管理・開発	0.35
投資証券	-	2.10
合計		97.47

## エマージング株式インデックス・マザーファンド

## イ 主要投資銘柄（上位30銘柄）

2023年12月29日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
台湾	株式	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	半導体・ 半導体製 造装置	864,000	2,657.45	2,296,039,430	2,745.23	2,371,882,348	6.24
香港	投資信 託受益 証券	CHINAAMC ETF SERIES - CH-CNY	-	2,192,800	713.5658	1,564,707,127	701.7515	1,538,800,592	4.05
韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	テクノロ ジー・ ハード ウェアお よび機器	167,320	8,033.58	1,344,178,963	8,674.25	1,451,375,510	3.82
アメリカ	投資証 券	ISHARES MSCI SAUDI ARABIA ETF	-	241,502	5,592.54	1,350,610,124	5,999.41	1,448,869,272	3.81
ケイマ ン諸島	株式	TENCENT HOLDINGS LTD	メディ ア・娯楽	233,700	5,753.98	1,344,704,548	5,317.95	1,242,804,915	3.27
ケイマ ン諸島	株式	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	一般消費 財・サー ビス流 通・小売 り	571,500	1,319.51	754,097,107	1,376.68	786,771,191	2.07
インド	株式	RELIANCE INDUSTRIES LTD	エネル ギー	106,817	4,129.14	441,061,964	4,481.55	478,705,299	1.26
アメリカ	投資証 券	ISHARES MSCI UAE ETF	-	206,099	2,096.34	432,053,129	2,104.76	433,788,354	1.14
ケイマ ン諸島	株式	PDD HOLDINGS INC	一般消費 財・サー ビス流 通・小売 り	20,946	20,108.03	421,182,749	20,614.99	431,801,591	1.14
インド	株式	ICICI BANK LTD	銀行	182,653	1,616.00	295,167,473	1,730.15	316,016,722	0.83
インド	株式	INFOSYS LTD	ソフト ウェア・ サービス	116,069	2,510.51	291,392,617	2,687.76	311,965,383	0.82
アメリカ	投資証 券	ISHARES MSCI QATAR ETF	-	120,610	2,449.62	295,448,296	2,571.38	310,133,888	0.82
韓国	株式	SK HYNIX INC	半導体・ 半導体製 造装置	19,106	14,409.20	275,302,175	15,635.75	298,736,639	0.79

インド	株式	HDFC BANK LIMITED	銀行	98,919	2,681.46	265,247,612	2,933.03	290,132,394	0.76
中国	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	3,364,000	81.31	273,533,568	84.03	282,692,058	0.74
ブラジル	株式	VALE SA	素材	119,188	2,143.30	255,455,685	2,252.73	268,498,011	0.71
ケイマン諸島	株式	MEITUAN-CLASS B	消費者サービス	177,060	1,641.67	290,673,647	1,494.65	264,643,171	0.70
アメリカ	投資証券	ISHARES MSCI KUWAIT ETF	-	60,106	4,226.63	254,045,646	4,383.68	263,485,567	0.69
台湾	株式	MEDIATEK INC	半導体・半導体製造装置	53,000	4,388.67	232,599,573	4,745.14	251,492,155	0.66
台湾	株式	HON HAI PRECISION INDUSTRY	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	436,800	472.20	206,256,435	481.46	210,300,679	0.55
インド	株式	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	ソフトウェア・サービス	31,793	6,043.65	192,145,764	6,535.83	207,793,579	0.55
韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	28,599	6,386.90	182,658,953	6,884.15	196,879,805	0.52
ブラジル	株式	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	エネルギー	167,300	1,028.03	171,988,664	1,086.68	181,801,245	0.48
ケイマン諸島	株式	NETEASE INC	メディア・娯楽	67,800	3,208.92	217,564,776	2,560.97	173,633,427	0.46
インドネシア	株式	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	銀行	1,947,400	81.88	159,453,112	86.48	168,411,152	0.44
ケイマン諸島	株式	JD.COM INC-CLASS A	一般消費財・サービス流通・小売り	82,285	1,934.79	159,204,195	2,043.69	168,165,031	0.44
ブラジル	株式	ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF	銀行	168,400	907.80	152,873,897	991.26	166,927,878	0.44
ケイマン諸島	株式	BAIDU INC-CLASS A	メディア・娯楽	79,050	2,089.07	165,140,588	2,085.44	164,853,636	0.43
ケイマン諸島	株式	XIAOMI CORP-CLASS B	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	540,600	280.96	151,888,057	295.48	159,737,569	0.42
中国	株式	IND & COMM BK OF CHINA-H	銀行	2,288,000	67.52	154,481,184	68.61	156,972,816	0.41

□ 種類別・業種別投資比率

2023年12月29日現在

種類	業種	投資比率(%)
株式(外国)	エネルギー	4.24
	素材	5.90
	資本財	3.79
	商業・専門サービス	0.04
	運輸	1.69
	自動車・自動車部品	3.37
	耐久消費財・アパレル	1.09
	消費者サービス	1.96
	一般消費財・サービス流通・小売り	4.99
	生活必需品流通・小売り	1.39
	食品・飲料・タバコ	2.30
	家庭用品・パーソナル用品	0.75
	ヘルスケア機器・サービス	0.67
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	2.32
	銀行	11.80
	金融サービス	2.27
	保険	2.15
	ソフトウェア・サービス	2.29
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	8.40
	半導体・半導体製造装置	9.09
電気通信サービス	1.92	
公益事業	2.10	
メディア・娯楽	5.44	
不動産管理・開発	1.00	
投資信託受益証券	-	4.05
投資証券	-	7.34
合計		92.35

## 外国債券パッシブ・マザーファンド

## イ 主要投資銘柄(上位30銘柄)

2023年12月29日現在

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価(円)	帳簿価額(円)	評価額単価(円)	評価額(円)	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	11,450,000	13,334.15	1,526,759,883	13,375.70	1,531,518,066	1.625	2026/05/15	0.90
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,200,000	13,557.39	1,111,705,805	13,600.08	1,115,206,453	2.250	2026/03/31	0.65
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	50,000,000	2,006.81	1,003,402,965	2,009.36	1,004,678,152	2.690	2026/08/12	0.59
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,200,000	12,418.92	894,162,129	12,467.42	897,654,551	0.625	2027/12/31	0.53
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	38,700,000	2,274.16	880,098,719	2,296.47	888,734,924	3.720	2051/04/12	0.52

中国	国債 証券	CHINA GOVERNMENT BOND	43,000,000	2,050.04	881,518,381	2,050.50	881,715,437	3.020	2031/05/27	0.52
アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B	6,100,000	13,718.65	836,837,563	13,799.21	841,751,689	3.500	2033/02/15	0.49
中国	国債 証券	CHINA GOVERNMENT BOND	41,000,000	1,985.73	814,147,452	1,994.63	817,799,070	2.400	2028/07/15	0.48
アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B	5,600,000	14,383.97	805,502,494	14,462.69	809,910,570	4.125	2032/11/15	0.47
中国	国債 証券	CHINA GOVERNMENT BOND	39,000,000	1,984.89	774,106,573	1,989.91	776,064,783	2.180	2025/08/25	0.45
アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B	5,700,000	13,111.47	747,354,037	13,182.67	751,412,361	2.875	2032/05/15	0.44
アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B	5,500,000	13,577.95	746,787,427	13,657.66	751,171,392	3.375	2033/05/15	0.44
アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B	5,300,000	14,038.90	744,061,738	14,070.53	745,738,026	3.875	2026/01/15	0.44
アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B	5,900,000	12,450.83	734,598,982	12,498.77	737,427,356	0.750	2028/01/31	0.43
アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B	5,300,000	13,507.89	715,918,127	13,558.81	718,616,727	2.750	2028/02/15	0.42
アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B	5,000,000	14,186.83	709,341,470	14,227.82	711,390,914	4.000	2028/02/29	0.42
アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B	5,000,000	14,129.81	706,490,687	14,216.19	710,809,411	3.875	2033/08/15	0.42
アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B	5,700,000	11,788.20	671,927,425	11,860.53	676,050,423	1.125	2031/02/15	0.40
アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B	5,500,000	12,122.49	666,737,156	12,192.84	670,606,279	1.625	2031/05/15	0.39
アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B	5,000,000	13,120.55	656,027,573	13,178.42	658,920,905	2.375	2029/03/31	0.39
アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B	4,800,000	13,530.30	649,454,320	13,574.55	651,578,366	2.625	2027/05/31	0.38
アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B	5,300,000	12,160.79	644,521,756	12,229.43	648,159,979	1.875	2032/02/15	0.38
中国	国債 証券	CHINA GOVERNMENT BOND	32,000,000	1,993.26	637,842,261	1,998.68	639,576,516	2.600	2030/09/15	0.37
中国	国債 証券	CHINA GOVERNMENT BOND	31,500,000	2,005.09	631,604,105	2,011.91	633,750,604	2.640	2028/01/15	0.37
フランス	国債 証券	FRANCE OAT.	4,200,000	14,743.20	619,214,319	14,840.61	623,305,724	0.750	2028/02/25	0.36
アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B	4,400,000	14,118.33	621,206,322	14,159.88	623,034,795	3.875	2027/12/31	0.36
アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B	4,500,000	13,800.63	621,028,184	13,830.55	622,374,860	2.625	2025/04/15	0.36
アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B	4,400,000	14,017.48	616,769,313	14,081.88	619,602,509	3.750	2030/06/30	0.36

中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	31,000,000	1,987.56	616,143,158	1,992.42	617,650,269	2.240	2025/05/25	0.36
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,500,000	13,650.57	614,275,658	13,672.27	615,252,157	1.000	2024/12/15	0.36

## 口 種類別投資比率

2023年12月29日現在

種類	投資比率(%)
国債証券	98.63
合計	98.63

## 米ドル建て新興国債インデックス・マザーファンド

### イ 主要投資銘柄(上位30銘柄)

2023年12月29日現在

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価(円)	帳簿価額(円)	評価額単価(円)	評価額(円)	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
ドミニカ共和国	国債証券	DOMINICAN REPUBLIC	1,700,000	13,005.59	221,095,099	14,012.52	238,212,845	6.000	2033/02/22	3.46
トルコ	国債証券	REPUBLIC OF TURKEY	1,400,000	15,062.43	210,873,978	15,788.94	221,045,175	9.875	2028/01/15	3.21
コロンビア	国債証券	REPUBLIC OF COLOMBIA	1,400,000	13,873.81	194,233,348	14,981.22	209,737,069	7.500	2034/02/02	3.04
アラブ首長国連邦	国債証券	ABU DHABI GOVT INT'L	1,700,000	11,665.29	198,309,968	12,044.20	204,751,461	1.875	2031/09/15	2.97
カタール	国債証券	STATE OF QATAR	1,400,000	13,574.06	190,036,882	13,863.32	194,086,412	3.750	2030/04/16	2.82
サウジアラビア	国債証券	SAUDI INTERNATIONAL BOND	1,600,000	11,411.78	182,588,538	11,779.12	188,465,973	2.250	2033/02/02	2.73
オマーン	国債証券	OMAN GOV INTERNTL BOND	1,200,000	14,476.23	173,714,802	14,941.93	179,303,187	6.250	2031/01/25	2.60
トルコ	国債証券	REPUBLIC OF TURKEY	1,100,000	14,540.00	159,939,989	15,713.91	172,853,043	9.125	2030/07/13	2.51
ブラジル	国債証券	FED REPUBLIC OF BRAZIL	1,200,000	13,466.77	161,601,243	14,208.81	170,505,756	6.000	2033/10/20	2.47
カタール	国債証券	STATE OF QATAR	1,300,000	12,648.73	164,433,447	13,099.28	170,290,600	4.400	2050/04/16	2.47
メキシコ	国債証券	UNITED MEXICAN STATES	1,200,000	11,820.96	141,851,558	12,041.08	144,493,000	2.659	2031/05/24	2.10
メキシコ	国債証券	UNITED MEXICAN STATES	1,000,000	13,252.40	132,523,966	13,701.77	137,017,708	4.875	2033/05/19	1.99

ハン ガ リー	国債 証券	HUNGARY	900,000	13,650.19	122,851,727	15,192.97	136,736,742	6.250	2032/09/22	1.98
メキ シコ	国債 証券	UNITED MEXICAN STATES	900,000	13,564.38	122,079,463	14,512.61	130,613,516	6.338	2053/05/04	1.90
パナ マ	国債 証券	REPUBLIC OF PANAMA	900,000	13,948.70	125,538,271	13,885.58	124,970,242	6.400	2035/02/14	1.81
コロ ンビ ア	国債 証券	REPUBLIC OF COLOMBIA	800,000	14,602.43	116,819,414	15,479.61	123,836,878	8.000	2033/04/20	1.80
ペ ルー	国債 証券	REPUBLIC OF PERU	1,000,000	12,052.57	120,525,715	12,378.92	123,789,224	2.783	2031/01/23	1.80
南ア フリ カ	国債 証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	900,000	12,215.91	109,943,212	13,482.64	121,343,791	7.300	2052/04/20	1.76
ペ ルー	国債 証券	REPUBLIC OF PERU	800,000	13,608.45	108,867,573	14,858.68	118,869,424	5.625	2050/11/18	1.72
トル コ	国債 証券	REPUBLIC OF TURKEY	800,000	13,198.98	105,591,867	14,000.75	112,005,987	6.125	2028/10/24	1.63
メキ シコ	国債 証券	UNITED MEXICAN STATES	900,000	12,324.03	110,916,307	12,383.46	111,451,148	5.000	2051/04/27	1.62
ドミ ニカ 共和 国	国債 証券	DOMINICAN REPUBLIC	900,000	10,698.76	96,288,812	12,339.07	111,051,613	5.875	2060/01/30	1.61
サウ ジア ラビ ア	国債 証券	SAUDI INTERNATIONAL BOND	800,000	12,258.65	98,069,204	13,401.09	107,208,729	5.000	2053/01/18	1.56
アラ ブ首 長国 連邦	国債 証券	ABU DHABI GOVT INT'L	1,000,000	10,354.87	103,548,664	10,450.32	104,503,180	3.125	2049/09/30	1.52
サウ ジア ラビ ア	国債 証券	SAUDI INTERNATIONAL BOND	700,000	13,731.17	96,118,191	14,497.01	101,479,081	4.875	2033/07/18	1.47
トル コ	国債 証券	REPUBLIC OF TURKEY	600,000	14,709.38	88,256,270	16,081.54	96,489,218	9.375	2033/01/19	1.40
アラ ブ首 長国 連邦	国債 証券	ABU DHABI GOVT INT'L	700,000	13,573.54	95,014,753	13,748.57	96,240,022	2.500	2025/04/16	1.40
チリ	国債 証券	REPUBLIC OF CHILE	800,000	11,309.67	90,477,328	11,766.22	94,129,734	2.550	2033/07/27	1.37
コロ ンビ ア	国債 証券	REPUBLIC OF COLOMBIA	800,000	10,873.54	86,988,310	11,591.48	92,731,857	3.125	2031/04/15	1.35
中国	国債 証券	CHINA GOVT INTL BOND	700,000	12,691.66	88,841,602	13,027.51	91,192,576	1.250	2026/10/26	1.32

□ 種類別投資比率

2023年12月29日現在



種類	投資比率(%)
国債証券	96.05
合計	96.05

## Jリート・インデックス・マザーファンド

## イ 主要投資銘柄(上位30銘柄)

2023年12月29日現在

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
日本	投資証券	日本ビルファンド投資法人	1,419	595,142.23	844,506,819	611,000.00	867,009,000	6.83
日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人	1,250	587,710.94	734,638,675	584,000.00	730,000,000	5.75
日本	投資証券	野村不動産マスターファンド投資法人	3,935	171,228.19	673,782,917	165,000.00	649,275,000	5.12
日本	投資証券	日本都市ファンド投資法人	5,833	98,822.36	576,430,815	101,900.00	594,382,700	4.68
日本	投資証券	GLP投資法人	4,108	139,418.70	572,732,000	140,500.00	577,174,000	4.55
日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人	2,118	286,828.23	607,502,190	271,400.00	574,825,200	4.53
日本	投資証券	KDX不動産投資法人	3,501	169,250.30	592,545,302	160,800.00	562,960,800	4.44
日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人	1,834	280,015.52	513,548,472	251,700.00	461,617,800	3.64
日本	投資証券	オリックス不動産投資法人	2,423	181,565.90	439,934,170	166,500.00	403,429,500	3.18
日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人	2,720	155,169.77	422,061,767	144,100.00	391,952,000	3.09
日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人	1,194	352,368.29	420,727,735	316,000.00	377,304,000	2.97
日本	投資証券	インヴィンシブル投資法人	5,891	58,954.88	347,303,180	61,000.00	359,351,000	2.83
日本	投資証券	日本プライムリアルティ投資法人	833	363,000.32	302,379,265	350,000.00	291,550,000	2.30
日本	投資証券	積水ハウス・リート投資法人	3,657	83,427.73	305,095,199	77,100.00	281,954,700	2.22
日本	投資証券	ジャパン・ホテル・リート投資法人	4,072	74,416.09	303,022,308	69,200.00	281,782,400	2.22
日本	投資証券	産業ファンド投資法人	1,858	142,989.83	265,675,113	139,600.00	259,376,800	2.04
日本	投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人	419	665,097.20	278,675,727	604,000.00	253,076,000	1.99

日本	投資証券	アクティブ・プロパティーズ投資法人	638	404,190.98	257,873,847	388,500.00	247,863,000	1.95
日本	投資証券	ラサールロジポート投資法人	1,558	150,078.56	233,822,394	152,000.00	236,816,000	1.87
日本	投資証券	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	507	485,315.47	246,054,942	457,500.00	231,952,500	1.83
日本	投資証券	日本ロジスティクスファンド投資法人	778	300,604.97	233,870,665	286,000.00	222,508,000	1.75
日本	投資証券	イオンリート投資法人	1,489	146,526.23	218,177,550	141,400.00	210,544,600	1.66
日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人	1,433	144,820.39	207,527,618	140,200.00	200,906,600	1.58
日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人	452	468,642.39	211,826,359	433,000.00	195,716,000	1.54
日本	投資証券	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	600	337,823.07	202,693,841	317,000.00	190,200,000	1.50
日本	投資証券	大和証券リビング投資法人	1,781	110,734.56	197,218,246	104,300.00	185,758,300	1.46
日本	投資証券	森トラストリート投資法人	2,350	74,006.85	173,916,096	72,500.00	170,375,000	1.34
日本	投資証券	ヒューリックリート投資法人	1,138	164,366.78	187,049,401	149,200.00	169,789,600	1.34
日本	投資証券	大和証券オフィス投資法人	251	670,717.15	168,350,005	665,000.00	166,915,000	1.32
日本	投資証券	三菱地所物流リート投資法人	419	396,197.93	166,006,931	374,500.00	156,915,500	1.24

## □ 種類別投資比率

2023年12月29日現在

種類	投資比率(%)
投資証券	98.67
合計	98.67

## 外国リート・インデックス・マザーファンド

### イ 主要投資銘柄(上位30銘柄)

2023年12月29日現在

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価(円)	帳簿価額(円)	評価額単価(円)	評価額(円)	投資比率(%)
アメリカ	投資証券	PROLOGIS INC	149,937	17,196.73	2,578,426,018	19,174.00	2,874,891,693	8.71
アメリカ	投資証券	EQUINIX INC	15,289	108,525.12	1,659,240,587	115,462.38	1,765,304,399	5.35
アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	90,088	11,510.41	1,036,949,417	12,929.22	1,164,767,823	3.53
アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	25,787	38,697.89	997,902,494	43,655.27	1,125,738,550	3.41

アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP INC	52,940	15,736.87	833,110,029	20,463.23	1,083,323,523	3.28
アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	117,947	7,951.27	937,828,481	8,308.40	979,951,019	2.97
アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	49,252	18,094.23	891,176,905	19,305.90	950,854,167	2.88
アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	34,285	17,978.94	616,408,029	22,999.15	788,525,953	2.39
アメリカ	投資証券	VICI PROPERTIES INC	166,963	4,299.11	717,792,216	4,564.09	762,034,058	2.31
オーストラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	280,151	2,175.67	609,515,600	2,443.86	684,649,094	2.07
アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	23,283	25,572.99	595,416,037	26,890.97	626,102,407	1.90
アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL	56,791	9,043.86	513,609,854	8,864.38	503,416,720	1.53
アメリカ	投資証券	IRON MOUNTAIN INC	47,715	8,584.87	409,627,009	10,013.20	477,779,742	1.45
アメリカ	投資証券	VENTAS INC	65,757	6,149.34	404,362,268	7,226.24	475,175,765	1.44
アメリカ	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	25,540	16,374.30	418,199,539	18,281.89	466,919,393	1.42
アメリカ	投資証券	INVITATION HOMES INC	94,601	4,755.32	449,858,487	4,921.50	465,578,916	1.41
アメリカ	投資証券	SUN COMMUNITIES INC	20,036	17,697.41	354,585,261	19,165.49	383,999,715	1.16
アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST INC	10,492	33,488.06	351,356,694	35,847.53	376,112,310	1.14
アメリカ	投資証券	MID-AMERICA APARTMENT COMM	19,263	20,120.44	387,580,103	19,366.89	373,064,334	1.13
香港	投資証券	LINK REIT	419,100	703.65	294,898,559	795.88	333,552,260	1.01
アメリカ	投資証券	WP CAREY INC	35,014	8,972.69	314,169,827	9,315.39	326,169,219	0.99
イギリス	投資証券	SEGRO PLC	200,140	1,310.50	262,283,838	1,621.06	324,439,140	0.98
アメリカ	投資証券	HOST HOTELS & RESORTS INC	112,402	2,226.66	250,280,832	2,789.80	313,578,661	0.95
アメリカ	投資証券	KIMCO REALTY CORP	100,590	2,654.09	266,974,918	3,091.89	311,013,617	0.94
アメリカ	投資証券	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	30,117	9,557.95	287,856,858	10,157.86	305,924,408	0.93
アメリカ	投資証券	GAMING AND LEISURE PROPERTIE	43,329	6,518.44	282,437,560	7,044.70	305,239,637	0.93
アメリカ	投資証券	REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	33,737	7,390.46	249,332,038	8,081.47	272,644,668	0.83
アメリカ	投資証券	UDR INC	48,632	5,491.66	267,070,292	5,498.75	267,415,166	0.81

アメリカ	投資証券	AMERICAN HOMES 4 RENT- A	51,482	5,023.38	258,613,721	5,148.43	265,051,421	0.80
アメリカ	投資証券	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	89,400	2,848.05	254,615,655	2,862.13	255,874,368	0.78

□ 種類別投資比率

2023年12月29日現在

種類	投資比率(%)
投資証券	97.31
合計	97.31

ゴールド・インデックス・マザーファンド

イ 主要投資銘柄

2023年12月29日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
アメリカ	投資信託受益証券	SPDR GOLD MINISHARES TRUST	871,010	5,508.7189	4,798,149,222	5,813.6117	5,063,713,926	63.08
アメリカ	投資信託受益証券	ISHARES GOLD TRUST	487,240	5,255.4114	2,560,646,659	5,545.5530	2,702,015,243	33.66

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

□ 種類別投資比率

2023年12月29日現在

種類	投資比率(%)
投資信託受益証券	96.73
合計	96.73

投資不動産物件

国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

該当事項はありません。

225マザーファンド

該当事項はありません。

外国株式インデックス・マザーファンド

該当事項はありません。

エマージング株式インデックス・マザーファンド

該当事項はありません。

外国債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

米ドル建て新興国債インデックス・マザーファンド

該当事項はありません。

#### Jリート・インデックス・マザーファンド

該当事項はありません。

#### 外国リート・インデックス・マザーファンド

該当事項はありません。

#### ゴールド・インデックス・マザーファンド

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

#### 国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

2023年12月29日現在

種類	国/ 地域	取引所 等	名称	買建/ 売建	数量	通貨	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
株価指数 先物取引	日本	大阪取引 所	TOPI X 先 物 0603 月 2024年 3月	買建	136	日本・円	3,199,859,600	3,217,760,000	1.13

（注）主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

#### 225マザーファンド

2023年12月29日現在

種類	国/ 地域	取引所 等	名称	買建/ 売建	数量	通貨	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
株価指数 先物取引	日本	大阪取引 所	NK22 5 先 物 0603 月 2024年 3月	買建	66	日本・円	2,176,382,600	2,207,700,000	1.42

（注）主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

#### 外国株式インデックス・マザーファンド

2023年12月29日現在

種類	国/ 地域	取引 所 等	名称	買建/ 売建	数量	通貨	帳簿価額	簿価 (円)	評価額	時価 (円)	投資 比率 (%)
株価 指数 先物 取引	イギ リス	IC E - EU	FTS E 10 0 ID X FU T MA R 24 2024年3 月	買建	47	イギリ ス・ポ ンド	3,597,174.00	649,937,398	3,640,385.00	657,744,761	0.11

ドイツ	EU RE X	EUR O S T O X X 5 0 M A R 2 4 2024年3 月	買建	322	ユーロ	14,729,854.00	2,314,354,660	14,634,900.00	2,299,435,488	0.37
アメリカ	シカ ゴ商 品取 引所	S & P 5 0 0 E M I N I F U T M A R 2 4 2024年3 月	買建	356	アメリ カ・ド ル	84,277,403.00	11,953,064,067	86,014,050.00	12,199,372,711	1.95
オース トラリ ア	シド ニー 先物 取引 所	S P I 2 0 0 F U T U R E S M A R 2 4 2024 年3月	買建	28	オース トラリ ア・ド ル	5,221,576.00	506,179,577	5,324,900.00	516,195,806	0.08

(注) 主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

2023年12月29日現在

種類	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約 取引	アメリカ・ドル	買建	12,359,000.00	1,755,900,579	1,751,054,430	0.28
	ユーロ	買建	1,500,000.00	236,176,069	235,493,518	0.04
	イギリス・ポンド	買建	612,000.00	111,017,809	110,464,500	0.02
	カナダ・ドル	買建	906,000.00	97,559,933	97,069,041	0.02
	スイス・フラン	買建	506,000.00	84,825,765	85,098,985	0.01
	オーストラリア・ドル	買建	408,000.00	39,686,568	39,520,716	0.01
	シンガポール・ドル	買建	309,000.00	33,183,911	33,183,417	0.01

(注) 日本における対顧客先物相場の仲値で評価しております。

#### エマージング株式インデックス・マザーファンド

2023年12月29日現在

種類	国/ 地域	取引 所等	名称	買建/ 売建	数量	通貨	帳簿価額	簿価 (円)	評価額	時価 (円)	投資 比率 (%)
株価 指数 先物 取引	アメ リカ	I C E - U S	M S C I E M G M K T M A R 2 4 2024年3月	買建	401	アメリ カ・ド ル	19,847,156.00	2,814,922,135	20,705,635.00	2,936,680,212	7.72

(注) 主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

2023年12月29日現在

種類	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)

為替予約 取引	アメリカ・ドル	買建	716,618.13	101,500,000	101,524,652	0.27
------------	---------	----	------------	-------------	-------------	------

(注) 日本における対顧客先物相場の仲値で評価しております。

#### 外国債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

#### 米ドル建て新興国債インデックス・マザーファンド

2023年12月29日現在

種類	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約 取引	アメリカ・ドル	買建	420,000.00	59,343,900	59,511,690	0.86

(注) 日本における対顧客先物相場の仲値で評価しております。

#### Jリート・インデックス・マザーファンド

2023年12月29日現在

種類	国/ 地域	取引所 等	名称	買建/ 売建	数量	通貨	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
リート指 数先物取 引	日本	大阪取引 所	TREI T 先 物 0603 月 2024年 3月	買建	20	日本・円	35,884,400	35,760,000	0.28

(注) 主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

#### 外国リート・インデックス・マザーファンド

2023年12月29日現在

種類	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約 取引	アメリカ・ドル	買建	465,978.29	66,000,000	66,016,029	0.20
	香港・ドル	買建	308,818.99	5,600,000	5,599,475	0.02
	イギリス・ポンド	買建	28,121.36	5,100,000	5,075,441	0.02

(注) 日本における対顧客先物相場の仲値で評価しております。

#### ゴールド・インデックス・マザーファンド

該当事項はありません。

#### 参考情報

基準日:2023年12月29日

※ファンドの運用実績はあくまで過去の実績であり、将来の運用成果を約束するものではありません。  
※委託会社ホームページにおいてもファンドの運用状況は適宜開示しています。

## 基準価額・純資産の推移

### ■TOPIXインデックス



※基準価額は、1万口当たり、信託報酬控除後です。

## 分配の推移

決算期	分配金
2023年11月	0円
2022年11月	0円
2021年11月	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万口当たり、税引前です。

### ■225インデックス



※基準価額は、1万口当たり、信託報酬控除後です。

決算期	分配金
2023年11月	0円
2022年11月	0円
2021年11月	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万口当たり、税引前です。

### ■先進国株インデックス



※基準価額は、1万口当たり、信託報酬控除後です。

決算期	分配金
2023年11月	0円
2022年11月	0円
2021年11月	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万口当たり、税引前です。



### ■新興国株インデックス

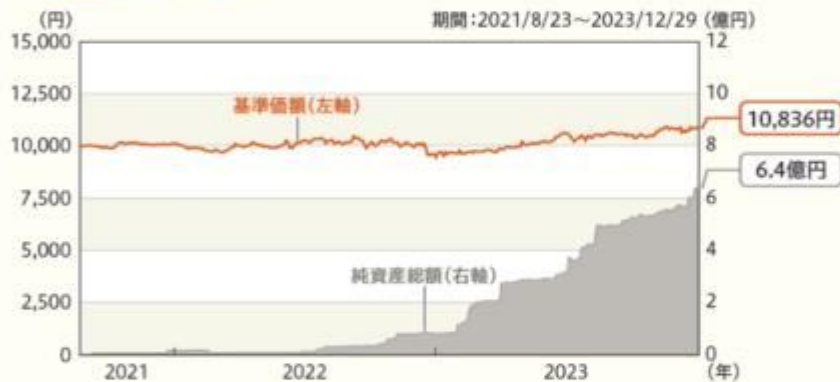


※基準価額は、1万口当たり、信託報酬控除後です。

決算期	分配金
2023年11月	0円
2022年11月	0円
2021年11月	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万口当たり、税引前です。

### ■先進国債インデックス



※基準価額は、1万口当たり、信託報酬控除後です。

決算期	分配金
2023年11月	0円
2022年11月	0円
2021年11月	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万口当たり、税引前です。

### ■新興国債インデックス

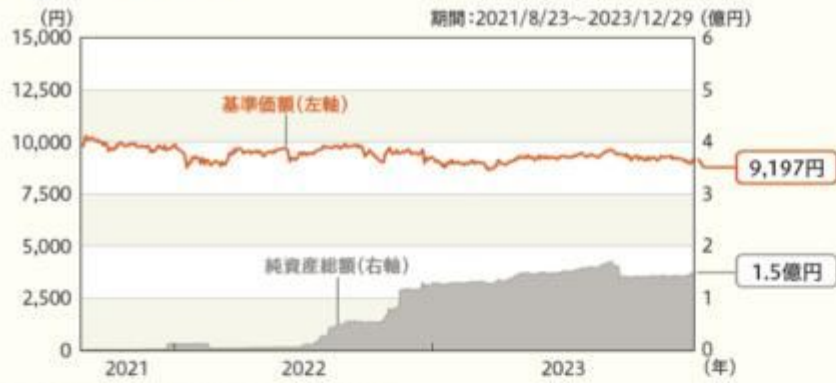


※基準価額は、1万口当たり、信託報酬控除後です。

決算期	分配金
2023年11月	0円
2022年11月	0円
2021年11月	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万口当たり、税引前です。

## ■Jリートインデックス

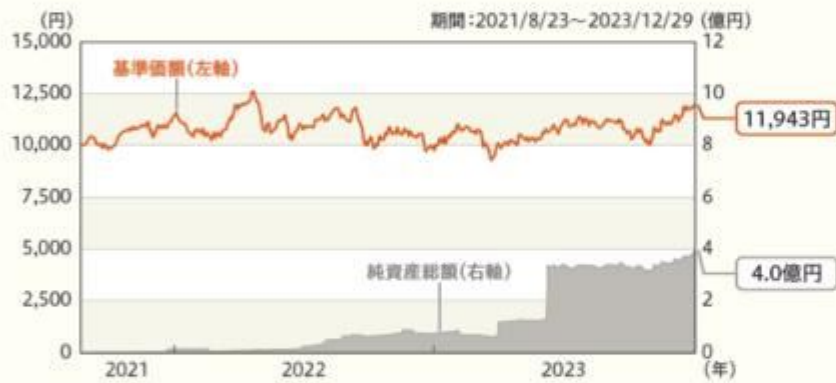


※基準価額は、1万口当たり、信託報酬控除後です。

決算期	分配金
2023年11月	0円
2022年11月	0円
2021年11月	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万口当たり、税引前です。

## ■Gリートインデックス



※基準価額は、1万口当たり、信託報酬控除後です。

決算期	分配金
2023年11月	0円
2022年11月	0円
2021年11月	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万口当たり、税引前です。

## ■ゴールドインデックスヘッジ有



※基準価額は、1万口当たり、信託報酬控除後です。

決算期	分配金
2023年11月	0円
2022年11月	0円
2021年11月	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万口当たり、税引前です。

## 主要な資産の状況

### ■TOPIXインデックス

#### 資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
親投資信託受益証券	日本	100.02
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		△0.02
合計(純資産総額)		100.00

#### 主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	比率(%)
日本	親投資信託受益証券	国内株式インデックス・マザーファンド(B号)	100.02

### ■国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

#### 資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
株式	日本	98.85
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1.15
合計(純資産総額)		100.00

※株価指数先物取引の買建て1.13%

#### 主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	業種	比率(%)
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	4.19
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	2.79
日本	株式	三菱UFJフィナンシャルグループ	銀行業	2.15
日本	株式	キーエンス	電気機器	1.83
日本	株式	信越化学工業	化学	1.58
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	1.58
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	1.51
日本	株式	日立製作所	電気機器	1.45
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1.42
日本	株式	三菱商事	卸売業	1.39

### ■225インデックス

#### 資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
親投資信託受益証券	日本	100.03
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		△0.03
合計(純資産総額)		100.00

#### 主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	比率(%)
日本	親投資信託受益証券	225マザーファンド	100.03

### ■225マザーファンド

#### 資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
株式	日本	98.58
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1.42
合計(純資産総額)		100.00

※株価指数先物取引の買建て1.42%

#### 主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	業種	比率(%)
日本	株式	ファーストリテイリング	小売業	10.30
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	7.43
日本	株式	アドバンテスト	電気機器	3.76
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	3.70
日本	株式	信越化学工業	化学	2.90
日本	株式	KDDI	情報・通信業	2.64
日本	株式	ダイキン工業	機械	2.25
日本	株式	ファナック	電気機器	2.03
日本	株式	TDK	電気機器	1.98
日本	株式	テルモ	精密機器	1.81

※比率は、ファンド、マザーファンドのそれぞれの純資産総額に対する時価の比率です。

※「主要投資銘柄(上位10銘柄)」は組入有価証券が10銘柄に満たない場合はすべてを記載しています。

## ■先進国株インデックス

## 資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
親投資信託受益証券	日本	100.03
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		△0.03
合計(純資産総額)		100.00

## 主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	比率(%)
日本	親投資信託受益証券	外国株式インデックス・マザーファンド	100.03

## ■外国株式インデックス・マザーファンド

## 資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
株式	アメリカ	68.34
	イギリス	3.79
	カナダ	3.37
	スイス	3.09
	フランス	3.06
	ドイツ	2.37
	その他	11.35
投資証券	アメリカ・その他	2.10
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		2.53
合計(純資産総額)		100.00

## 主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	業種	比率(%)
アメリカ	株式	APPLE INC	テクノロジー/ハードウェアおよび機器	5.21
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	4.56
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	一般消費財・サービス流通・小売り	2.45
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	2.11
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	1.43
アメリカ	株式	META PLATFORMS INC-CLASS A	メディア・娯楽	1.37
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	1.27
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	1.24
アメリカ	株式	BROADCOM INC	半導体・半導体製造装置	0.86
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	0.85

※株価指数先物取引の買建て2.50%

## ■新興国株インデックス

## 資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
親投資信託受益証券	日本	100.04
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		△0.04
合計(純資産総額)		100.00

## 主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	比率(%)
日本	親投資信託受益証券	エマージング株式インデックス・マザーファンド	100.04

## ■エマージング株式インデックス・マザーファンド

## 資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
株式	インド	15.60
	台湾	14.38
	ケイマン諸島	14.00
	韓国	12.01
	その他	24.97
投資証券	アメリカ	6.46
	その他	0.88
投資信託受益証券	香港	4.05
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		7.65
合計(純資産総額)		100.00

## 主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	業種	比率(%)
台湾	株式	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	半導体・半導体製造装置	6.24
香港	投資信託受益証券	CHINAAMC ETF SERIES - CH-CNY	-	4.05
韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	テクノロジー/ハードウェアおよび機器	3.82
アメリカ	投資証券	ISHARES MSCI SAUDI ARABIA ETF	-	3.81
ケイマン諸島	株式	TENCENT HOLDINGS LTD	メディア・娯楽	3.27
ケイマン諸島	株式	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	一般消費財・サービス流通・小売り	2.07
インド	株式	RELIANCE INDUSTRIES LTD	エネルギー	1.26
アメリカ	投資証券	ISHARES MSCI UAE ETF	-	1.14
ケイマン諸島	株式	PODD HOLDINGS INC	一般消費財・サービス流通・小売り	1.14
インド	株式	ICICI BANK LTD	銀行	0.83

※株価指数先物取引の買建て7.72%

※比率は、ファンド、マザーファンドのそれぞれの純資産総額に対する時価の比率です。

※「主要投資銘柄(上位10銘柄)」は組入る有価証券が10銘柄に満たない場合はすべてを記載しています。

## ■先進国債インデックス

## 資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
親投資信託受益証券	日本	100.02
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		△0.02
合計(純資産総額)		100.00

## ■外国債券パッシブ・マザーファンド

## 資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
国債証券	アメリカ	46.19
	フランス	8.38
	イタリア	7.50
	中国	7.37
	ドイツ	6.56
	イギリス	5.22
	スペイン	4.88
	その他	12.52
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1.37
合計(純資産総額)		100.00

## ■新興国債インデックス

## 資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
親投資信託受益証券	日本	99.03
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		0.97
合計(純資産総額)		100.00

## ■米ドル建て新興国債インデックス・マザーファンド

## 資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
国債証券	メキシコ	9.97
	トルコ	9.57
	サウジアラビア	9.42
	ブラジル	7.86
	アラブ首長国連邦	7.01
	コロンビア	6.19
	チリ	6.10
	その他	39.94
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		3.95
合計(純資産総額)		100.00

※比率は、ファンド、マザーファンドのそれぞれの純資産総額に対する時価の比率です。

※「主要投資銘柄(上位10銘柄)」は組入有価証券が10銘柄に満たない場合はすべてを記載しています。

## 主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	比率(%)
日本	親投資信託受益証券	外国債券パッシブ・マザーファンド	100.02

## 主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	利率(%)	償還期限	比率(%)
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.625	2026/05/15	0.90
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.250	2026/03/31	0.65
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	2.690	2026/08/12	0.59
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	0.625	2027/12/31	0.53
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	3.720	2051/04/12	0.52
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	3.020	2031/05/27	0.52
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3.500	2033/02/15	0.49
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	2.400	2028/07/15	0.48
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4.125	2032/11/15	0.47
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	2.180	2025/08/25	0.45

## 主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	比率(%)
日本	親投資信託受益証券	米ドル建て新興国債インデックス・マザーファンド	99.03

## 主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	利率(%)	償還期限	比率(%)
ドミニカ共和国	国債証券	DOMINICAN REPUBLIC	6.000	2033/02/22	3.46
トルコ	国債証券	REPUBLIC OF TURKEY	9.875	2028/01/15	3.21
コロンビア	国債証券	REPUBLIC OF COLOMBIA	7.500	2034/02/02	3.04
アラブ首長国連邦	国債証券	ABU DHABI GOVT INTL	1.875	2031/09/15	2.97
カタール	国債証券	STATE OF QATAR	3.750	2030/04/16	2.82
サウジアラビア	国債証券	SAUDI INTERNATIONAL BOND	2.250	2033/02/02	2.73
オマーン	国債証券	OMAN GOV INTERNTL BOND	6.250	2031/01/25	2.60
トルコ	国債証券	REPUBLIC OF TURKEY	9.125	2030/07/13	2.51
ブラジル	国債証券	FED REPUBLIC OF BRAZIL	6.000	2033/10/20	2.47
カタール	国債証券	STATE OF QATAR	4.400	2050/04/16	2.47

## ■Jリートインデックス

## 資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
親投資信託受益証券	日本	100.03
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		△0.03
合計(純資産総額)		100.00

## 主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	比率(%)
日本	親投資信託受益証券	Jリート・インデックス・マザーファンド	100.03

## ■Jリート・インデックス・マザーファンド

## 資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
投資証券	日本	98.67
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1.33
合計(純資産総額)		100.00

※リート指数先物取引の買建て0.28%

## 主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	比率(%)
日本	投資証券	日本ビルファンド投資法人	6.83
日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人	5.75
日本	投資証券	野村不動産マスターファンド投資法人	5.12
日本	投資証券	日本都市ファンド投資法人	4.68
日本	投資証券	GLP投資法人	4.55
日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人	4.53
日本	投資証券	KDX不動産投資法人	4.44
日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人	3.64
日本	投資証券	オリックス不動産投資法人	3.18
日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人	3.09

## ■Gリートインデックス

## 資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
親投資信託受益証券	日本	100.03
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		△0.03
合計(純資産総額)		100.00

## 主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	比率(%)
日本	親投資信託受益証券	外国リート・インデックス・マザーファンド	100.03

## ■外国リート・インデックス・マザーファンド

## 資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
投資証券	アメリカ	75.55
	オーストラリア	6.63
	イギリス	4.76
	シンガポール	3.34
	フランス	1.78
	カナダ	1.46
	香港	1.18
	その他	2.59
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		2.69
合計(純資産総額)		100.00

## 主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	比率(%)
アメリカ	投資証券	PROLOGIS INC	8.71
アメリカ	投資証券	EQUINIX INC	5.35
アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	3.53
アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	3.41
アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP INC	3.28
アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	2.97
アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	2.88
アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	2.39
アメリカ	投資証券	VICI PROPERTIES INC	2.31
オーストラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	2.07

※比率は、ファンド、マザーファンドのそれぞれの純資産総額に対する時価の比率です。

※「主要投資銘柄(上位10銘柄)」は組入有価証券が10銘柄に満たない場合はすべてを記載しています。

## ■ゴールドインデックスヘッジ有

### 資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
親投資信託受益証券	日本	99.17
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		0.83
合計(純資産総額)		100.00

### 主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	比率(%)
日本	親投資信託受益証券	ゴールド・インデックス・マザーファンド	99.17

## ■ゴールド・インデックス・マザーファンド

### 資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
投資信託受益証券	アメリカ	96.73
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		3.27
合計(純資産総額)		100.00

### 主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	比率(%)
アメリカ	投資信託受益証券	SPDR Gold Minishares Trust	63.08
アメリカ	投資信託受益証券	ISHARES GOLD TRUST	33.66

※比率は、ファンド、マザーファンドのそれぞれの純資産総額に対する時価の比率です。

※「主要投資銘柄(上位10銘柄)」は組入有価証券が10銘柄に満たない場合はすべてを記載しています。

## 年間収益率の推移(暦年ベース)

### ■TOPIXインデックス(ベンチマーク:TOPIX(東証株価指数、配当込み))



### ■225インデックス(ベンチマーク:日経平均株価(日経225))



※ファンドの収益率は、分配金(税引前)を分配時に再投資したものと仮定して計算しています。分配実績がない場合は、基準価額の騰落率です。

※ファンドが設定された年のファンドの収益率は、設定日から年末までの騰落率です。

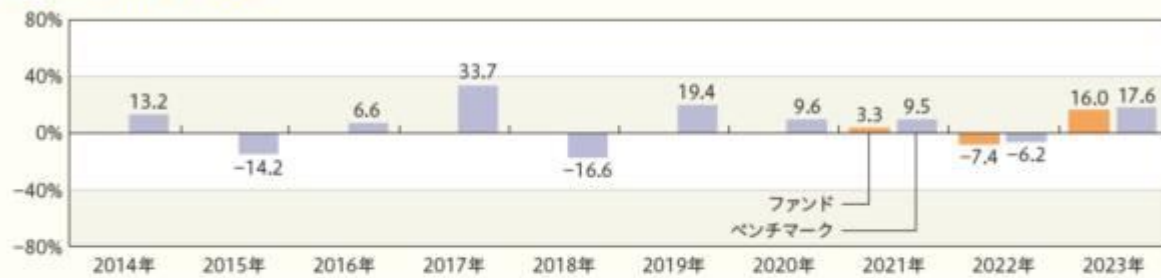
※2023年の収益率は、年初から基準日までの騰落率です。

※ベンチマークの情報は参考情報であり、ファンドの運用実績ではありません。

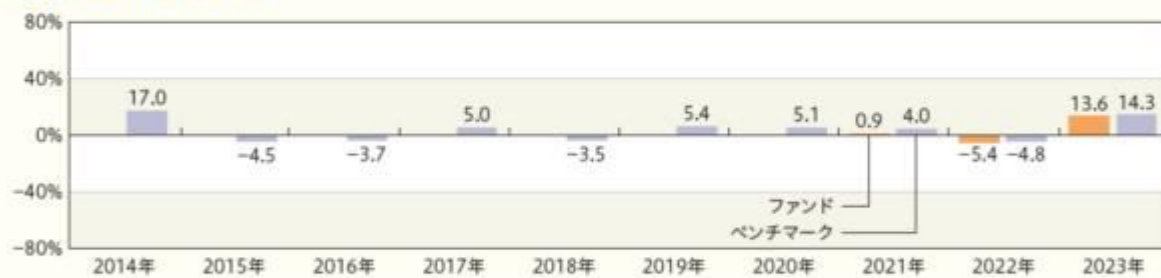
### ■先進国株インデックス(ベンチマーク:MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円換算ベース))



### ■新興国株インデックス(ベンチマーク:MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円換算ベース))



### ■先進国債インデックス(ベンチマーク:FTSE世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース))



### ■新興国債インデックス(ベンチマーク:JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス(円換算ベース))



※ファンドの収益率は、分配金(税引前)を分配時に再投資したものと仮定して計算しています。分配実績がない場合は、基準価額の騰落率です。

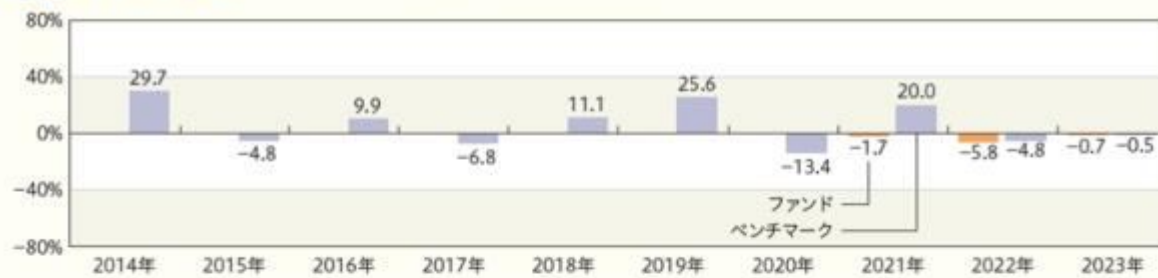
※ファンドが設定された年のファンドの収益率は、設定日から年末までの騰落率です。

※2023年の収益率は、年初から基準日までの騰落率です。

※ベンチマークの情報は参考情報であり、ファンドの運用実績ではありません。



### ■Jリートインデックス(ベンチマーク:東証REIT指数(配当込み))



### ■Gリートインデックス(ベンチマーク:S&P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、円換算ベース))



### ■ゴールドインデックスヘッジ有(ベンチマーク:LBMA金価格(円ヘッジ換算ベース))



※ファンドの収益率は、分配金(税引前)を分配時に再投資したものと仮定して計算しています。分配実績がない場合は、基準価額の騰落率です。  
 ※ファンドが設定された年のファンドの収益率は、設定日から年末までの騰落率です。  
 ※2023年の収益率は、年初から基準日までの騰落率です。  
 ※ベンチマークの情報は参考情報であり、ファンドの運用実績ではありません。

## 第2【管理及び運営】

### 1【申込（販売）手続等】

#### イ 申込方法

(イ) ファンドの取得申込者は、お申込みを取り扱う販売会社取引口座を開設の上、当ファンドの取得申込みを行っていただきます。

当ファンドには、「分配金受取りコース」と「分配金自動再投資コース」の2つの申込方法がありますが、販売会社によってはいずれか一方のみの取扱いとなる場合があります。販売会社によっては、「スイッチング」（ある投資信託の換金による手取額をもって、他の投資信託を買い付けること）による当ファンドの取得申込みを取り扱う場合があります。お申込みの販売会社にお問い合わせください。

(ロ) 原則として午後3時までに取得申込みが行われ、販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の申込受付分とします。

なお、取引所等における取引の停止、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるときは、取得申込みの受付を中止させていただく場合、既に受け付けた取得申込みを取り消させていただく場合があります。

(ハ) 当ファンドの取得申込者は販売会社に、取得申込みと同時にまたはあらかじめ当該取得申込者

が受益権の振替を行うための振替機関等の口座を申し出るものとし、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録が行われます。

販売会社は、当該取得申込みの代金の支払いと引換えに、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録を行うことができます。

ファンドのお買付けに関しましては、クーリング・オフ制度の適用はありません。

## (二) 申込不可日

上記にかかわらず、各ファンドにつき、取得申込日が以下の申込不可日に当たる場合には、ファンドの取得申込みはできません（また、該当日には、解約請求のお申込みもできません。）。

ファンド名	申込不可日
先進国株インデックス	・ ニューヨークの取引所の休業日 ・ ロンドンの取引所の休業日
新興国株インデックス	・ ニューヨークの取引所の休業日 ・ ロンドンの取引所の休業日 ・ 香港の取引所の休業日
先進国債インデックス	・ ニューヨークの銀行の休業日 ・ ロンドンの銀行の休業日
新興国債インデックス	・ ニューヨークの取引所の休業日 ・ ロンドンの取引所の休業日 ・ ニューヨークの銀行の休業日 ・ ロンドンの銀行の休業日
Gリートインデックス	・ ニューヨークの取引所の休業日 ・ オーストラリアの取引所の休業日 ・ ニューヨークの銀行の休業日
ゴールドインデックスヘッジ有	・ ニューヨークの取引所の休業日 ・ ニューヨークの銀行の休業日

「TOPIXインデックス」、「225インデックス」、「Jリートインデックス」は、申込不可日はありません。

## ロ 申込価額

取得申込受付日の翌営業日の基準価額となります。

ただし、累積投資契約に基づく収益分配金の再投資の場合は、各計算期末の基準価額となります。

## ハ 申込手数料

原則として、申込金額（取得申込受付日の翌営業日の基準価額×申込口数）に、1.1%（税抜き1.0%）を上限として、販売会社がそれぞれ別に定める申込手数料率を乗じて得た額となります。

累積投資契約に基づく収益分配金の再投資の場合は無手数料となります。

申込手数料に関する詳細は、お申込みの販売会社にお問い合わせください。

## ニ 申込単位

お申込単位の詳細は、お申込みの販売会社にお問い合わせください。

## ホ 照会先

手続き等のご不明な点についての委託会社に対する照会は下記においてできます。

照会先の名称	コールセンター	ホームページ
三井住友D Sアセットマネジメント株式会社	0120-88-2976	<a href="https://www.smd-am.co.jp">https://www.smd-am.co.jp</a>

お問い合わせは、午前9時～午後5時（土、日、祝・休日を除く）までとさせていただきます。

## ヘ 申込取扱場所・払込取扱場所

販売会社において申込み・払込みを取り扱います。

## ト 払込期日

取得申込者は、申込金額（取得申込受付日の翌営業日の基準価額×申込口数）に申込手数料および当該手数料にかかる消費税等相当額を加算した額を、販売会社の指定の期日までに、指定の方法でお支払いください。

各取得申込みにかかる発行価額の総額は、追加信託が行われる日に、委託会社の指定する口座を経由して、受託会社の指定するファンド口座に払い込まれます。

## 2【換金（解約）手続等】

受益者は、自己に帰属する受益権につき、解約請求（一部解約の実行請求）により換金することができます。

お買付けの販売会社にお申し出ください。

ただし、以下の申込不可日に当たる場合には、解約請求の受け付けは行いません。

ファンド名	申込不可日
先進国株インデックス	<ul style="list-style-type: none"> <li>・ニューヨークの取引所の休業日</li> <li>・ロンドンの取引所の休業日</li> </ul>
新興国株インデックス	<ul style="list-style-type: none"> <li>・ニューヨークの取引所の休業日</li> <li>・ロンドンの取引所の休業日</li> <li>・香港の取引所の休業日</li> </ul>
先進国債インデックス	<ul style="list-style-type: none"> <li>・ニューヨークの銀行の休業日</li> <li>・ロンドンの銀行の休業日</li> </ul>
新興国債インデックス	<ul style="list-style-type: none"> <li>・ニューヨークの取引所の休業日</li> <li>・ロンドンの取引所の休業日</li> <li>・ニューヨークの銀行の休業日</li> <li>・ロンドンの銀行の休業日</li> </ul>
Gリートインデックス	<ul style="list-style-type: none"> <li>・ニューヨークの取引所の休業日</li> <li>・オーストラリアの取引所の休業日</li> <li>・ニューヨークの銀行の休業日</li> </ul>
ゴールドインデックスヘッジ有	<ul style="list-style-type: none"> <li>・ニューヨークの取引所の休業日</li> <li>・ニューヨークの銀行の休業日</li> </ul>

「TOPIXインデックス」、「225インデックス」、「Jリートインデックス」は、申込不可日はありません。

解約請求のお申込みに関しては、原則として午後3時までに解約請求のお申込みが行われ、販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の解約請求受付分とします。

なお、信託財産の資金管理を円滑に行うため、大口の換金申込みに制限を設ける場合があります。

解約請求を行う受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して当該受益者の請求にかかるファンドの信託契約の一部解約を委託会社が行うのと引換えに、当該解約請求にかかる受益権の口数と同口数の抹消の申請を行うものとし、社振法の規定に従い当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行われます。

一部解約金は、解約請求受付日から起算して6営業日目からお支払いします。

一部解約価額は、解約請求受付日の翌営業日の基準価額となります。

解約単位の詳細および一部解約価額につきましては、お申込みの販売会社にお問い合わせください。

委託会社は、取引所等における取引の停止、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるときは、一部解約の実行の請求の受け付けを中止すること、および既に受け付けた一部解約の実行請求を取り消すことがあります。この場合、受益者は当該受付中止以前に行った当日の一部解約の実行の請求を撤回できます。受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約の実行の請求を受け付けたものとして、上記に準じた取扱いとなります。

### 3【資産管理等の概要】

#### (1)【資産の評価】

##### イ 基準価額の算出方法

基準価額とは、信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券および借入れ有価証券を除きます。）を法令および一般社団法人投資信託協会規則に従って時価評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額（「純資産総額」といいます。）を、計算日における受益権総口数で除した金額をいいます（基準価額は、便宜上1万口単位で表示される場合があります。）。投資対象とする親投資信託受益証券は、当該親投資信託受益証券の基準価額で評価します。なお、外貨建資産の円換算については、原則として日本における計算日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算するものとします。また、予約為替の評価は、原則として日本における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によるものとします。

<主要投資対象の評価方法>

「各マザーファンド（ゴールド・インデックス・マザーファンドを除く）」

主要投資対象	有価証券等の評価方法
株式、投資証券、債券等	(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 原則として、金融商品取引所、外国金融商品市場の最終相場で評価します。 (2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 原則として、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除く。）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価します。
市場デリバティブ取引	原則として、金融商品取引所、外国金融商品市場の発表する清算値段または最終相場で評価します。

国内で取引される資産については原則として基準価額計算日の値、外国で取引される資産については原則として基準価額計算日に知りうる直近の日の値で評価します。

「ゴールド・インデックス・マザーファンド」

主要投資対象	有価証券等の評価方法
投資信託証券	原則として、基準価額計算日に知りうる直近の純資産価格（基準価額）で評価します。また、上場されている場合は、その主たる取引所における最終相場で評価します。

国内で取引される資産については原則として基準価額計算日の値、外国で取引される資産については原則として基準価額計算日に知りうる直近の日の値で評価します。

##### ロ 基準価額の算出頻度・照会方法

基準価額は、委託会社の営業日において日々算出されます。

基準価額は、販売会社または委託会社にお問い合わせいただけるほか、原則として翌日付の日本経済新聞朝刊の証券欄「オープン基準価格」の紙面に、以下の通り掲載されます。

ファンド名	掲載名
TOPIXインデックス	SMDTPイ
225インデックス	SMD225イ
先進国株インデックス	SMD先株イ
新興国株インデックス	SMD興株イ
先進国債インデックス	SMD先債イ
新興国債インデックス	SMD興債イ
Jリートインデックス	SMDJリイ
Gリートインデックス	SMDGリイ
ゴールドインデックスヘッジ有	SMD金イH

委託会社に対する照会は下記においてできます。

照会先の名称	コールセンター	ホームページ
三井住友D Sアセットマネジメント株式会社	0120-88-2976	<a href="https://www.smd-am.co.jp">https://www.smd-am.co.jp</a>

お問い合わせは、午前9時～午後5時(土、日、祝・休日を除く)までとさせていただきます。

## (2) 【保管】

ファンドの受益権は社振法の規定の適用を受け、受益権の帰属は振替機関等の振替口座簿に記載または記録されることにより定まるため、原則として受益証券は発行されません。したがって、受益証券の保管に関する該当事項はありません。

## (3) 【信託期間】

2021年8月23日から下記「(5) その他 イ 信託の終了」に記載された各事由が生じた場合における信託終了の日までとなります。

## (4) 【計算期間】

毎年12月1日から翌年11月30日までとすることを原則としますが、各計算期間終了日に該当する日(以下「該当日」といいます。)が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始するものとします。なお、最終計算期間の終了日は、信託期間の終了日とします。

## (5) 【その他】

### イ 信託の終了

#### (イ) 信託契約の解約

- a. 委託会社は、当ファンドの信託契約を解約することが受益者にとって有利であると認めるとき、各ファンドの残存口数が30億口を下回ることとなったとき、その他やむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意の上、当ファンドの信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。
- b. 委託会社は、上記aの事項について、書面による決議(以下「書面決議」といいます。)を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、当ファンドの知っている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。
- c. 書面決議において、受益者(委託会社等を除きます。)は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行行使することができます。なお、知っている受益者が議決権を行行使しないときは、当該知っている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
- d. 書面決議は議決権を行行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。
- e. 上記b～dまでの取扱いは、委託会社が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、当ファンドのすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、信託財産の状況に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、上記b～dまでの取扱いを行うことが困難な場合も同様とします。

#### (ロ) 信託契約に関する監督官庁の命令

委託会社は、監督官庁より当ファンドの信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令に従い信託契約を解約し、信託を終了させます。

#### （八）委託会社の登録取消等に伴う取扱い

委託会社が、監督官庁より登録の取消しを受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は当ファンドの信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁が当ファンドに関する委託会社の業務を他の委託会社に引継ぐことを命じたときは、当ファンドは、その委託会社と受託会社との間において存続します。

#### （二）受託会社の辞任および解任に伴う取扱い

- a. 受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。また、受託会社はその任務に違反して信託財産に著しい損害を与えたこと、その他重要な事由があるときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を申し立てることができます。
- b. 上記により受託会社が辞任し、または解任された場合は、委託会社は新受託会社を選任します。
- c. 委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社は当ファンドの信託契約を解約し、信託を終了させます。

#### ロ 収益分配金、償還金の支払い

##### （イ）収益分配金

- a. 分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。委託会社の判断により分配を行わない場合もあるため、将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。
- b. 分配金は、原則として、税金を差し引いた後、毎計算期間終了日後1ヵ月以内の委託会社の指定する日（原則として決算日から起算して5営業日目まで）から、販売会社において、決算日の振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（当該収益分配金にかかる決算日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる決算日以前に設定された受益権で取得申込代金支払い前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者として）に支払われます。  
ただし、分配金自動再投資コースにかかる収益分配金は、原則として、税金を差し引いた後、累積投資契約に基づいて、毎計算期間終了日の翌営業日に無手数料で再投資され、再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

##### （ロ）償還金

償還金は、信託終了後1ヵ月以内の委託会社の指定する日（原則として償還日から起算して5営業日目まで）から、販売会社において、原則として、償還日の振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（償還日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該償還日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者として）に支払われます。

#### 八 信託約款の変更等

- （イ）委託会社は、当ファンドの信託約款を変更することが受益者の利益のため必要と認めるとき、監督官庁より変更の命令を受けたとき、その他やむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意の上、当ファンドの信託約款を変更すること、または当ファンドと他のファンドとの併合（投資信託及び投資法人に関する法律第16条第2号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。）を行うことができるものとし、あらかじめ、変更または併合しようとする旨および内容を監督官庁に届け出ます。
- （ロ）委託会社は、上記（イ）の事項（変更についてはその内容が重大なものに該当する場合に限り、併合にあっては、その併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当する場合を除きます。以下、合わせて「重大な信託約款の変更等」といいます。）について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに重大な信託約款の変更等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、当ファンドの知っている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。
- （ハ）上記（ロ）の書面決議において、受益者（委託会社等を除きます。）は受益権の口数に応じ

て、議決権を有し、これを行行使することができます。なお、知っている受益者が議決権を行行使しないときは、当該知っている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

- (二) 書面決議は議決権を行行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います(書面決議は、当ファンドのすべての受益者に対してその効力を生じます。)
- (ホ) 上記(ロ)から(二)までの取扱いは、委託会社が重大な信託約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、当ファンドのすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。
- (ヘ) 上記にかかわらず、当ファンドと他のファンドとの併合の場合は、当ファンドにおいて併合の書面決議が可決された場合にあっては、相手方となる他のファンドにおいて当該併合の書面決議が否決された場合は、併合を行うことはできません。

## 二 反対受益者の受益権買取請求の不適用

当ファンドは、受益者が一部解約の実行の請求を行ったときは、委託会社が信託契約の一部解約をすることにより当該請求に応じ、当該受益権の公正な価格が当該受益者に一部解約金として支払われることとなる委託者指図型投資信託に該当するため、信託契約の解約または重大な信託約款の変更等を行う場合において、投資信託及び投資法人に関する法律第18条第1項に定める反対受益者による受益権の買取請求の規定の適用を受けません。

## ホ 販売会社との契約の更改等

委託会社と販売会社との間で締結される販売契約(名称の如何を問わず、ファンドの募集・販売の取扱い、受益者からの一部解約実行請求の受付け、受益者への収益分配金、一部解約金および償還金の支払事務等を規定するもの)は、期間満了の3ヵ月前に当事者のいずれから、何らの意思表示もない場合は、自動的に1年間更新されます。販売契約の内容は、必要に応じて、委託会社と販売会社との合意により変更されることがあります。

## へ 委託会社の事業の譲渡および承継に伴う取扱い

委託会社の事業の全部または一部の譲渡、もしくは分割承継により、当ファンドに関する事業が譲渡・承継されることがあります。

## ト 公告

委託会社が受益者に対してする公告は、電子公告の方法により行い、次のアドレスに掲載します。

<https://www.smd-am.co.jp>

なお、電子公告による公告をすることができない事故その他やむを得ない事由が生じた場合の公告は、日本経済新聞に掲載します。

## チ 運用にかかる報告書の開示方法

委託会社は毎決算後、投資信託及び投資法人に関する法律の規定に従い、期中の運用経過のほか、信託財産の内容、有価証券売買状況などを記載した運用報告書(全体版)および運用報告書(全体版)の記載事項のうち重要なものを記載した交付運用報告書を作成します。

交付運用報告書は、原則として、あらかじめ受益者が申し出た住所に販売会社から届けられます。なお、運用報告書(全体版)は、委託会社のホームページで閲覧できます。

## 4【受益者の権利等】

委託会社の指図に基づく行為によりファンドに生じた利益および損失は、すべて受益者に帰属します。当ファンドの受益権は、信託の日時を異にすることにより差異が生ずることはありません。

受益者の有する主な権利は次の通りです。

### イ 分配金請求権

受益者は、委託会社の決定した収益分配金を持分に依りて請求する権利を有します。

収益分配金は、原則として、税金を差し引いた後、毎計算期間終了日後1ヵ月以内の委託会社の指定する日(原則として決算日から起算して5営業日目まで)から、販売会社において、決算日の振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者(当該収益分配金にかかる決算日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる決算日以前に設定された受益権で取得申込代金支払い前のため販売会社の名義で記載または

記録されている受益権については原則として取得申込者とします。)に支払われます。

ただし、分配金自動再投資コースをお申込みの場合の収益分配金は、原則として、税金を差し引いた後、累積投資契約に基づき、毎計算期間終了日の翌営業日に無手数料で再投資され、再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

収益分配金は、受益者が、その支払開始日から5年間その支払いを請求しないときは、受益者はその権利を失い、当該金銭は、委託会社に帰属します。

#### ロ 償還金請求権

受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

償還金は、信託終了後1ヵ月以内の委託会社の指定する日(原則として償還日から起算して5営業日目まで)から、販売会社において、原則として、償還日の振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者(償還日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該償還日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とします。)に支払われます。

償還金は、受益者がその支払開始日から10年間その支払いを請求しないときは、受益者はその権利を失い、当該金銭は、委託会社に帰属します。

#### ハ 一部解約実行請求権

受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託会社に一部解約の実行を請求することができます。詳細は、前記「第2 管理及び運営 2 換金(解約)手続等」の記載をご参照ください。

#### ニ 書面決議における議決権

委託会社が、当ファンドの解約(監督官庁の命令による解約等の場合を除きます。)または、重大な信託約款の変更等を行おうとする場合において、受益者は、それぞれの書面決議手続きにおいて、受益権の口数に応じて議決権を有しこれを行行使することができます。

#### ホ 帳簿閲覧・謄写請求権

受益者は委託会社に対し、当該受益者にかかる信託財産に関する書類の閲覧または謄写を請求することができます。



### 第3【ファンドの経理状況】

1. 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)ならびに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。  
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
2. 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第3期(2022年12月1日から2023年11月30日まで)の財務諸表について、PwC Japan有限責任監査法人により監査を受けております。

#### 1【財務諸表】

## 【三井住友DS・TOPIXインデックス・ファンド】

## (1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第2期 (2022年11月30日現在)	第3期 (2023年11月30日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	84	23
コール・ローン	519	1,406
親投資信託受益証券	61,811,019	284,533,386
流動資産合計	61,811,622	284,534,815
<b>資産合計</b>		
61,811,622		
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払受託者報酬	4,635	22,333
未払委託者報酬	77,353	369,323
その他未払費用	1,065	5,493
流動負債合計	83,053	397,149
<b>負債合計</b>		
83,053		
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	56,998,952	214,939,118
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	4,729,617	69,198,548
(分配準備積立金)	2,721,892	28,950,496
元本等合計	61,728,569	284,137,666
<b>純資産合計</b>		
61,728,569		
<b>負債純資産合計</b>		
61,811,622		
284,534,815		

## ( 2 ) 【損益及び剰余金計算書】

( 単位：円 )

	第2期		第3期	
	自	2021年12月 1日	自	2022年12月 1日
	至	2022年11月30日	至	2023年11月30日
<b>営業収益</b>				
有価証券売買等損益		3,088,520		31,170,687
<b>営業収益合計</b>		<b>3,088,520</b>		<b>31,170,687</b>
<b>営業費用</b>				
支払利息		-		24
受託者報酬		6,016		32,051
委託者報酬		101,066		530,399
その他費用		1,352		7,863
<b>営業費用合計</b>		<b>108,434</b>		<b>570,337</b>
営業利益又は営業損失 ( )		2,980,086		30,600,350
経常利益又は経常損失 ( )		2,980,086		30,600,350
当期純利益又は当期純損失 ( )		2,980,086		30,600,350
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額 ( )		36,828		3,791,694
期首剰余金又は期首欠損金 ( )		172,961		4,729,617
剰余金増加額又は欠損金減少額		1,642,270		42,176,909
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		1,642,270		42,176,909
剰余金減少額又は欠損金増加額		28,872		4,516,634
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		28,872		4,516,634
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		-
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金 ( )		4,729,617		69,198,548

## (3) 【注記表】

## (重要な会計方針の注記)

項目	第3期	
	自 2022年12月1日 至 2023年11月30日	
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>	

## (重要な会計上の見積りに関する注記)

会計上の見積りについて、翌計算期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクがある項目を識別していないため、注記を省略しております。

## (貸借対照表に関する注記)

項目	第2期	第3期
	(2022年11月30日現在)	(2023年11月30日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	56,998,952口	214,939,118口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.0830円 (1万口当たりの純資産額10,830円)	1口当たり純資産額 1.3219円 (1万口当たりの純資産額13,219円)

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第2期	第3期
	自 2021年12月1日 至 2022年11月30日	自 2022年12月1日 至 2023年11月30日
分配金の計算過程	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益（749,005円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（1,959,470円）、収益調整金（2,007,725円）、および分配準備積立金（13,417円）より、分配対象収益は4,729,617円（1万口当たり829.77円）であります。分配を行っておりません。</p>	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益（3,743,976円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（23,064,680円）、収益調整金（40,248,052円）、および分配準備積立金（2,141,840円）より、分配対象収益は69,198,548円（1万口当たり3,219.45円）であります。分配を行っておりません。</p>

## (金融商品に関する注記)

## . 金融商品の状況に関する事項

項目	第3期 自 2022年12月1日 至 2023年11月30日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	(1) 金融商品の内容 1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、親投資信託受益証券を組み入れております。 2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。 3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 (2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。

<p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p>	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。なお、投資信託協会の流動性リスク管理規制に抵触する場合には、流動性リスクを管理する会議で審議の上、流動性リスクの管理責任者が対処方針を決定します。その後、決定した対処方針やその実施等について、リスク管理会議に報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>
--------------------------	--

・金融商品の時価等に関する事項

項目	第3期 (2023年11月30日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（親投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

第2期（自 2021年12月1日 至 2022年11月30日）

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	3,051,263円
合計	3,051,263円

## 第3期(自 2022年12月1日 至 2023年11月30日)

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	27,644,318円
合計	27,644,318円

## (デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

## (関連当事者との取引に関する注記)

第3期 自 2022年12月1日 至 2023年11月30日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

## (その他の注記)

項 目	第2期 (2022年11月30日現在)	第3期 (2023年11月30日現在)
期首元本額	5,873,388円	56,998,952円
期中追加設定元本額	52,125,564円	190,811,491円
期中一部解約元本額	1,000,000円	32,871,325円

## (4)【附属明細表】

## 有価証券明細表

## (a)株式

該当事項はありません。

## (b)株式以外の有価証券

(単位：円)

種 類	銘 柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	国内株式インデックス・マザーファンド(B号)	68,065,303	284,533,386	
	親投資信託受益証券 小計		284,533,386	
合 計			284,533,386	

## デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 【三井住友D S ・日経225インデックス・ファンド】

## ( 1 ) 【貸借対照表】

( 単位：円 )

	第2期 ( 2022年11月30日現在 )	第3期 ( 2023年11月30日現在 )
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	177	25
コール・ローン	1,094	1,524
親投資信託受益証券	272,785,410	516,567,983
流動資産合計	272,786,681	516,569,532
資産合計	272,786,681	516,569,532
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払受託者報酬	20,288	41,259
未払委託者報酬	335,423	681,482
その他未払費用	5,003	10,234
流動負債合計	360,714	732,975
負債合計	360,714	732,975
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	257,073,979	399,203,245
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 ( )	15,351,988	116,633,312
( 分配準備積立金 )	4,052,087	65,218,441
元本等合計	272,425,967	515,836,557
純資産合計	272,425,967	515,836,557
負債純資産合計	272,786,681	516,569,532



## ( 2 ) 【損益及び剰余金計算書】

( 単位：円 )

	第2期		第3期	
	自 至	2021年12月 1日 2022年11月30日	自 至	2022年12月 1日 2023年11月30日
<b>営業収益</b>				
有価証券売買等損益		7,944,616		69,340,963
<b>営業収益合計</b>		<b>7,944,616</b>		<b>69,340,963</b>
<b>営業費用</b>				
支払利息		8		121
受託者報酬		30,082		71,786
委託者報酬		497,842		1,186,117
その他費用		7,367		17,788
<b>営業費用合計</b>		<b>535,299</b>		<b>1,275,812</b>
営業利益又は営業損失 ( )		7,409,317		68,065,151
経常利益又は経常損失 ( )		7,409,317		68,065,151
当期純利益又は当期純損失 ( )		7,409,317		68,065,151
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額 ( )		537,771		5,742,979
期首剰余金又は期首欠損金 ( )		2,428,653		15,351,988
剰余金増加額又は欠損金減少額		7,001,684		45,099,149
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		7,001,684		45,099,149
剰余金減少額又は欠損金増加額		949,895		6,139,997
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		949,895		6,139,997
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		-
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金 ( )		15,351,988		116,633,312

## ( 3 ) 【注記表】

## ( 重要な会計方針の注記 )

項 目	第3期	
	自 2022年12月1日 至 2023年11月30日	
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>	

## ( 重要な会計上の見積りに関する注記 )

会計上の見積りについて、翌計算期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクがある項目を識別していないため、注記を省略しております。

## ( 貸借対照表に関する注記 )

項 目	第2期	第3期
	( 2022年11月30日現在 )	( 2023年11月30日現在 )
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	257,073,979口	399,203,245口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.0597円 ( 1万口当たりの純資産額10,597円 )	1口当たり純資産額 1.2922円 ( 1万口当たりの純資産額12,922円 )

## ( 損益及び剰余金計算書に関する注記 )

項 目	第2期	第3期
	自 2021年12月1日 至 2022年11月30日	自 2022年12月1日 至 2023年11月30日
分配金の計算過程	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益 ( 2,875,577円 )、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益 ( 1,038,748円 )、収益調整金 ( 11,299,901円 )、および分配準備積立金 ( 137,762円 ) より、分配対象収益は 15,351,988円 ( 1万口当たり597.18円 ) ありますが、分配を行っておりません。</p>	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益 ( 6,320,760円 )、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益 ( 56,001,412円 )、収益調整金 ( 51,414,871円 )、および分配準備積立金 ( 2,896,269円 ) より、分配対象収益は116,633,312円 ( 1万口当たり2,921.65円 ) ありますが、分配を行っておりません。</p>

## (金融商品に関する注記)

## . 金融商品の状況に関する事項

項 目	第3期 自 2022年12月1日 至 2023年11月30日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	(1) 金融商品の内容 1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、親投資信託受益証券を組み入れております。 2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。 3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 (2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。

<p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p>	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。なお、投資信託協会の流動性リスク管理規制に抵触する場合には、流動性リスクを管理する会議で審議の上、流動性リスクの管理責任者が対処方針を決定します。その後、決定した対処方針やその実施等について、リスク管理会議に報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>
--------------------------	--

・金融商品の時価等に関する事項

項目	第3期 (2023年11月30日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（親投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

第2期（自 2021年12月1日 至 2022年11月30日）

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	7,454,335円
合計	7,454,335円

## 第3期（自 2022年12月1日 至 2023年11月30日）

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	64,520,487円
合計	64,520,487円

## （デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （関連当事者との取引に関する注記）

第3期 自 2022年12月1日 至 2023年11月30日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

## （その他の注記）

項 目	第2期 (2022年11月30日現在)	第3期 (2023年11月30日現在)
期首元本額	67,088,151円	257,073,979円
期中追加設定元本額	221,907,962円	233,724,846円
期中一部解約元本額	31,922,134円	91,595,580円

## （4）【附属明細表】

## 有価証券明細表

## (a) 株式

該当事項はありません。

## (b) 株式以外の有価証券

（単位：円）

種 類	銘 柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受 益証券	2 2 5 マザーファンド	113,484,036	516,567,983	
	親投資信託受益証券 小計		516,567,983	
合 計			516,567,983	

## デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 【三井住友D S ・先進国株式インデックス・ファンド】

## ( 1 ) 【貸借対照表】

( 単位 : 円 )

	第2期 ( 2022年11月30日現在 )	第3期 ( 2023年11月30日現在 )
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	189	29
コール・ローン	1,163	1,758
親投資信託受益証券	309,573,888	827,293,404
未収入金	-	11,850,450
流動資産合計	309,575,240	839,145,641
資産合計	309,575,240	839,145,641
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	-	11,850,439
未払受託者報酬	25,267	74,892
未払委託者報酬	518,715	1,536,321
その他未払費用	7,510	22,389
流動負債合計	551,492	13,484,041
負債合計	551,492	13,484,041
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	278,407,177	612,172,511
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 ( )	30,616,571	213,489,089
( 分配準備積立金 )	9,686,410	109,333,912
元本等合計	309,023,748	825,661,600
純資産合計	309,023,748	825,661,600
負債純資産合計	309,575,240	839,145,641

## ( 2 ) 【損益及び剰余金計算書】

( 単位：円 )

	第2期		第3期	
	自	2021年12月 1日 至 2022年11月30日	自	2022年12月 1日 至 2023年11月30日
<b>営業収益</b>				
有価証券売買等損益		11,800,039		113,498,466
<b>営業収益合計</b>		<b>11,800,039</b>		<b>113,498,466</b>
<b>営業費用</b>				
支払利息		37		92
受託者報酬		37,289		115,403
委託者報酬		766,067		2,367,656
その他費用		11,036		34,467
<b>営業費用合計</b>		<b>814,429</b>		<b>2,517,618</b>
営業利益又は営業損失 ( )		10,985,610		110,980,848
経常利益又は経常損失 ( )		10,985,610		110,980,848
当期純利益又は当期純損失 ( )		10,985,610		110,980,848
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額 ( )		2,401,628		8,360,622
期首剰余金又は期首欠損金 ( )		4,566,401		30,616,571
剰余金増加額又は欠損金減少額		21,691,934		99,326,563
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		21,691,934		99,326,563
剰余金減少額又は欠損金増加額		4,225,746		19,074,271
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		4,225,746		19,074,271
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		-
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金 ( )		30,616,571		213,489,089

## (3)【注記表】

## (重要な会計方針の注記)

項目	第3期	
	自 2022年12月1日 至 2023年11月30日	
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>	

## (重要な会計上の見積りに関する注記)

会計上の見積りについて、翌計算期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクがある項目を識別していないため、注記を省略しております。

## (貸借対照表に関する注記)

項目	第2期	第3期
	(2022年11月30日現在)	(2023年11月30日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	278,407,177口	612,172,511口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.1100円 (1万口当たりの純資産額11,100円)	1口当たり純資産額 1.3487円 (1万口当たりの純資産額13,487円)

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第2期	第3期
	自 2021年12月1日 至 2022年11月30日	自 2022年12月1日 至 2023年11月30日
分配金の計算過程	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(2,868,645円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(5,715,337円)、収益調整金(20,930,161円)、および分配準備積立金(1,102,428円)より、分配対象収益は30,616,571円(1万口当たり1,099.70円)ですが、分配を行っておりません。</p>	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(9,549,590円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(93,070,636円)、収益調整金(104,155,177円)、および分配準備積立金(6,713,686円)より、分配対象収益は213,489,089円(1万口当たり3,487.40円)ですが、分配を行っておりません。</p>



## (金融商品に関する注記)

## . 金融商品の状況に関する事項

項 目	第3期 自 2022年12月1日 至 2023年11月30日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	(1) 金融商品の内容 1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、親投資信託受益証券を組み入れております。 2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。 3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 (2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。

<p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p>	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。なお、投資信託協会の流動性リスク管理規制に抵触する場合には、流動性リスクを管理する会議で審議の上、流動性リスクの管理責任者が対処方針を決定します。その後、決定した対処方針やその実施等について、リスク管理会議に報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>
--------------------------	--

・金融商品の時価等に関する事項

項目	第3期 (2023年11月30日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（親投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

第2期（自 2021年12月1日 至 2022年11月30日）

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	9,583,936円
合計	9,583,936円

## 第3期(自 2022年12月1日 至 2023年11月30日)

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	107,057,506円
合計	107,057,506円

## (デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

## (関連当事者との取引に関する注記)

第3期 自 2022年12月1日 至 2023年11月30日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

## (その他の注記)

項 目	第2期 (2022年11月30日現在)	第3期 (2023年11月30日現在)
期首元本額	70,018,428円	278,407,177円
期中追加設定元本額	270,552,214円	476,514,487円
期中一部解約元本額	62,163,465円	142,749,153円

## (4)【附属明細表】

## 有価証券明細表

## (a) 株式

該当事項はありません。

## (b) 株式以外の有価証券

(単位：円)

種 類	銘 柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	外国株式インデックス・マザーファンド	110,398,522	827,293,404	
	親投資信託受益証券 小計		827,293,404	
合 計			827,293,404	

## デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 【三井住友D S ・新興国株式インデックス・ファンド】

## ( 1 ) 【貸借対照表】

( 単位 : 円 )

	第2期 ( 2022年11月30日現在 )	第3期 ( 2023年11月30日現在 )
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	80	1,690
コール・ローン	494	101,478
親投資信託受益証券	22,536,778	131,229,668
流動資産合計	22,537,352	131,332,836
<b>資産合計</b>	<b>22,537,352</b>	<b>131,332,836</b>
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	-	101,823
未払受託者報酬	1,839	12,987
未払委託者報酬	38,694	267,220
その他未払費用	575	4,469
流動負債合計	41,108	386,499
<b>負債合計</b>	<b>41,108</b>	<b>386,499</b>
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	22,559,233	118,594,913
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 ( )	62,989	12,351,424
( 分配準備積立金 )	273,906	10,462,750
元本等合計	22,496,244	130,946,337
<b>純資産合計</b>	<b>22,496,244</b>	<b>130,946,337</b>
<b>負債純資産合計</b>	<b>22,537,352</b>	<b>131,332,836</b>

## ( 2 ) 【損益及び剰余金計算書】

( 単位：円 )

	第2期		第3期	
	自	2021年12月 1日 至 2022年11月30日	自	2022年12月 1日 至 2023年11月30日
営業収益				
受取利息		-		2
有価証券売買等損益		502,275		11,162,000
営業収益合計		502,275		11,162,002
営業費用				
受託者報酬		2,814		18,298
委託者報酬		59,220		377,318
その他費用		861		6,258
営業費用合計		62,895		401,874
営業利益又は営業損失( )		565,170		10,760,128
経常利益又は経常損失( )		565,170		10,760,128
当期純利益又は当期純損失( )		565,170		10,760,128
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額( )		516,037		225,222
期首剰余金又は期首欠損金( )		64,352		62,989
剰余金増加額又は欠損金減少額		-		1,879,507
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		1,019
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		1,878,488
剰余金減少額又は欠損金増加額		78,208		-
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		9,647		-
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		68,561		-
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金( )		62,989		12,351,424

## (3)【注記表】

## (重要な会計方針の注記)

項目	第3期	
	自 2022年12月1日 至 2023年11月30日	
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>	

## (重要な会計上の見積りに関する注記)

会計上の見積りについて、翌計算期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクがある項目を識別していないため、注記を省略しております。

## (貸借対照表に関する注記)

項目	第2期	第3期
	(2022年11月30日現在)	(2023年11月30日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	22,559,233口	118,594,913口
2. 「投資信託財産の計算に関する規則」第55条の6第10号に規定する額	元本の欠損 62,989円	元本の欠損
3. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 0.9972円 (1万口当たりの純資産額9,972円)	1口当たり純資産額 1.1041円 (1万口当たりの純資産額11,041円)

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第2期	第3期
	自 2021年12月1日 至 2022年11月30日	自 2022年12月1日 至 2023年11月30日
分配金の計算過程	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(271,266円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(95,484円)、および分配準備積立金(2,640円)より、分配対象収益は369,390円(1万口当たり163.74円)ですが、分配を行っておりません。</p>	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(2,225,857円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(8,026,566円)、収益調整金(1,891,136円)、および分配準備積立金(210,327円)より、分配対象収益は12,353,886円(1万口当たり1,041.69円)ですが、分配を行っておりません。</p>

## （金融商品に関する注記）

## ・金融商品の状況に関する事項

項 目	第3期 自 2022年12月1日 至 2023年11月30日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	(1) 金融商品の内容 1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、親投資信託受益証券を組み入れております。 2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。 3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 (2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。

<p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p>	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。なお、投資信託協会の流動性リスク管理規制に抵触する場合には、流動性リスクを管理する会議で審議の上、流動性リスクの管理責任者が対処方針を決定します。その後、決定した対処方針やその実施等について、リスク管理会議に報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>
--------------------------	--

・金融商品の時価等に関する事項

項目	第3期 (2023年11月30日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（親投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

第2期（自 2021年12月1日 至 2022年11月30日）



種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	11,693円
合計	11,693円

## 第3期(自 2022年12月1日 至 2023年11月30日)

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	11,029,364円
合計	11,029,364円

## (デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

## (関連当事者との取引に関する注記)

第3期 自 2022年12月1日 至 2023年11月30日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

## (その他の注記)

項 目	第2期 (2022年11月30日現在)	第3期 (2023年11月30日現在)
期首元本額	2,960,151円	22,559,233円
期中追加設定元本額	29,976,495円	107,220,605円
期中一部解約元本額	10,377,413円	11,184,925円

## (4)【附属明細表】

## 有価証券明細表

## (a)株式

該当事項はありません。

## (b)株式以外の有価証券

(単位：円)

種 類	銘 柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受 益証券	エマージング株式インデックス・マ ザーファンド	71,378,661	131,229,668	
	親投資信託受益証券 小計		131,229,668	
合 計			131,229,668	

## デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 【三井住友D S・先進国債インデックス・ファンド】

## ( 1 ) 【貸借対照表】

( 単位 : 円 )

	第2期 ( 2022年11月30日現在 )	第3期 ( 2023年11月30日現在 )
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	89	23
コール・ローン	549	1,373
親投資信託受益証券	80,186,585	569,134,298
流動資産合計	80,187,223	569,135,694
資産合計	80,187,223	569,135,694
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払受託者報酬	3,703	49,879
未払委託者報酬	46,809	623,918
その他未払費用	851	12,378
流動負債合計	51,363	686,175
負債合計	51,363	686,175
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	79,842,763	525,007,101
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 ( )	293,097	43,442,418
( 分配準備積立金 )	472,369	34,099,436
元本等合計	80,135,860	568,449,519
純資産合計	80,135,860	568,449,519
負債純資産合計	80,187,223	569,135,694

## ( 2 ) 【損益及び剰余金計算書】

( 単位：円 )

	第2期		第3期	
	自	2021年12月 1日 至 2022年11月30日	自	2022年12月 1日 至 2023年11月30日
<b>営業収益</b>				
有価証券売買等損益		1,387,274		36,597,363
<b>営業収益合計</b>		<b>1,387,274</b>		<b>36,597,363</b>
<b>営業費用</b>				
支払利息		-		22
受託者報酬		4,891		69,426
委託者報酬		61,901		868,682
その他費用		1,094		17,188
<b>営業費用合計</b>		<b>67,886</b>		<b>955,318</b>
営業利益又は営業損失 ( )		1,455,160		35,642,045
経常利益又は経常損失 ( )		1,455,160		35,642,045
当期純利益又は当期純損失 ( )		1,455,160		35,642,045
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額 ( )		263,394		471,834
期首剰余金又は期首欠損金 ( )		25,013		293,097
剰余金増加額又は欠損金減少額		1,567,191		7,979,110
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		78,355
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		1,567,191		7,900,755
剰余金減少額又は欠損金増加額		107,341		-
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		107,341		-
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		-
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金 ( )		293,097		43,442,418

## (3)【注記表】

## (重要な会計方針の注記)

項目	第3期	
	自 2022年12月1日 至 2023年11月30日	
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(ただし、売気配相場は使用しない)、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>	

## (重要な会計上の見積りに関する注記)

会計上の見積りについて、翌計算期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクがある項目を識別していないため、注記を省略しております。

## (貸借対照表に関する注記)

項目	第2期	第3期
	(2022年11月30日現在)	(2023年11月30日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	79,842,763口	525,007,101口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.0037円 (1万口当たりの純資産額10,037円)	1口当たり純資産額 1.0827円 (1万口当たりの純資産額10,827円)

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第2期	第3期
	自 2021年12月1日 至 2022年11月30日	自 2022年12月1日 至 2023年11月30日
分配金の計算過程	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(460,737円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(450,582円)、および分配準備積立金(11,632円)より、分配対象収益は922,951円(1万口当たり115.60円)ですが、分配を行っておりません。</p>	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(7,667,486円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(26,003,741円)、収益調整金(9,342,982円)、および分配準備積立金(428,209円)より、分配対象収益は43,442,418円(1万口当たり827.46円)ですが、分配を行っておりません。</p>

## (金融商品に関する注記)

## . 金融商品の状況に関する事項

項 目	第3期 自 2022年12月1日 至 2023年11月30日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	(1) 金融商品の内容 1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、親投資信託受益証券を組み入れております。 2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。 3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 (2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。

<p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p>	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。なお、投資信託協会の流動性リスク管理規制に抵触する場合には、流動性リスクを管理する会議で審議の上、流動性リスクの管理責任者が対処方針を決定します。その後、決定した対処方針やその実施等について、リスク管理会議に報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>
--------------------------	--

・金融商品の時価等に関する事項

項目	第3期 (2023年11月30日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（親投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

第2期（自 2021年12月1日 至 2022年11月30日）

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	1,121,627円
合計	1,121,627円

## 第3期(自 2022年12月1日 至 2023年11月30日)

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	36,200,856円
合計	36,200,856円

## (デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

## (関連当事者との取引に関する注記)

第3期 自 2022年12月1日 至 2023年11月30日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

## (その他の注記)

項 目	第2期 (2022年11月30日現在)	第3期 (2023年11月30日現在)
期首元本額	6,762,046円	79,842,763円
期中追加設定元本額	86,535,230円	467,002,780円
期中一部解約元本額	13,454,513円	21,838,442円

## (4)【附属明細表】

## 有価証券明細表

## (a)株式

該当事項はありません。

## (b)株式以外の有価証券

(単位：円)

種 類	銘 柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受 益証券	外国債券パッシブ・マザーファンド	262,770,349	569,134,298	
	親投資信託受益証券 小計		569,134,298	
合 計			569,134,298	

## デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 【三井住友D S ・新興国債インデックス・ファンド】

## ( 1 ) 【貸借対照表】

( 単位 : 円 )

	第2期 ( 2022年11月30日現在 )	第3期 ( 2023年11月30日現在 )
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	29,399	8,644
コール・ローン	181,396	519,037
親投資信託受益証券	11,381,577	34,291,040
流動資産合計	11,592,372	34,818,721
資産合計	11,592,372	34,818,721
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払受託者報酬	1,024	2,433
未払委託者報酬	21,590	50,857
その他未払費用	408	938
流動負債合計	23,022	54,228
負債合計	23,022	54,228
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	12,592,578	34,734,364
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 ( )	1,023,228	30,129
( 分配準備積立金 )	302,215	1,687,857
元本等合計	11,569,350	34,764,493
純資産合計	11,569,350	34,764,493
負債純資産合計	11,592,372	34,818,721



## （ 2 ） 【 損益及び剰余金計算書 】

（ 単位：円 ）

	第2期		第3期	
	自	2021年12月 1日	自	2022年12月 1日
	至	2022年11月30日	至	2023年11月30日
<b>営業収益</b>				
受取利息		-		1
有価証券売買等損益		507,186		1,972,463
営業収益合計		507,186		1,972,464
<b>営業費用</b>				
支払利息		-		16
受託者報酬		1,578		3,744
委託者報酬		33,501		78,710
その他費用		408		938
営業費用合計		35,487		83,408
営業利益又は営業損失（ ）		542,673		1,889,056
経常利益又は経常損失（ ）		542,673		1,889,056
当期純利益又は当期純損失（ ）		542,673		1,889,056
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）		286		5,554
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		13,240		1,023,228
剰余金増加額又は欠損金減少額		-		1,154,382
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		1,154,382
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		-
剰余金減少額又は欠損金増加額		467,601		1,995,635
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		62		-
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		467,539		1,995,635
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		1,023,228		30,129

## （ 3 ）【注記表】

## （重要な会計方針の注記）

項 目	第3期	
	自 2022年12月1日 至 2023年11月30日	
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>	

## （重要な会計上の見積りに関する注記）

会計上の見積りについて、翌計算期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクがある項目を識別していないため、注記を省略しております。

## （貸借対照表に関する注記）

項 目	第2期	第3期
	( 2022年11月30日現在 )	( 2023年11月30日現在 )
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	12,592,578口	34,734,364口
2. 「投資信託財産の計算に関する規則」第55条の6第10号に規定する額	元本の欠損 1,023,228円	元本の欠損
3. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 0.9187円 ( 1万口当たりの純資産額9,187円 )	1口当たり純資産額 1.0009円 ( 1万口当たりの純資産額10,009円 )

## （損益及び剰余金計算書に関する注記）

項 目	第2期	第3期
	自 2021年12月1日 至 2022年11月30日	自 2022年12月1日 至 2023年11月30日
分配金の計算過程	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益（286,739円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（0円）、収益調整金（156,603円）、および分配準備積立金（15,476円）より、分配対象収益は458,818円（1万口当たり364.36円）であります。分配を行っておりません。</p>	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益（838,966円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（737,416円）、収益調整金（1,283,087円）、および分配準備積立金（111,475円）より、分配対象収益は2,970,944円（1万口当たり855.33円）であります。分配を行っておりません。</p>

## （金融商品に関する注記）

## ・金融商品の状況に関する事項

項 目	第3期 自 2022年12月1日 至 2023年11月30日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	(1) 金融商品の内容 1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、親投資信託受益証券を組み入れております。 2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。 3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 (2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。

<p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p>	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。なお、投資信託協会の流動性リスク管理規制に抵触する場合には、流動性リスクを管理する会議で審議の上、流動性リスクの管理責任者が対処方針を決定します。その後、決定した対処方針やその実施等について、リスク管理会議に報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>
--------------------------	--

・金融商品の時価等に関する事項

項目	第3期 (2023年11月30日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（親投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

第2期（自 2021年12月1日 至 2022年11月30日）

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	507,186円
合計	507,186円

## 第3期(自 2022年12月1日 至 2023年11月30日)

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	1,999,255円
合計	1,999,255円

## (デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

## (関連当事者との取引に関する注記)

第3期 自 2022年12月1日 至 2023年11月30日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

## (その他の注記)

項 目	第2期 (2022年11月30日現在)	第3期 (2023年11月30日現在)
期首元本額	1,621,093円	12,592,578円
期中追加設定元本額	10,979,714円	35,198,756円
期中一部解約元本額	8,229円	13,056,970円

## (4)【附属明細表】

## 有価証券明細表

## (a)株式

該当事項はありません。

## (b)株式以外の有価証券

(単位：円)

種 類	銘 柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	米ドル建て新興国債インデックス・マザーファンド	33,428,583	34,291,040	
	親投資信託受益証券 小計		34,291,040	
合 計			34,291,040	

## デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 【三井住友D S ・国内リートインデックス・ファンド】

## ( 1 ) 【貸借対照表】

( 単位 : 円 )

	第2期 ( 2022年11月30日現在 )	第3期 ( 2023年11月30日現在 )
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	91	21
コール・ローン	565	1,263
親投資信託受益証券	118,143,132	143,336,888
流動資産合計	118,143,788	143,338,172
資産合計	118,143,788	143,338,172
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払受託者報酬	4,927	16,539
未払委託者報酬	81,852	273,649
その他未払費用	1,145	4,060
流動負債合計	87,924	294,248
負債合計	87,924	294,248
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	122,970,950	152,933,447
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 ( )	4,915,086	9,889,523
( 分配準備積立金 )	995,182	6,042,685
元本等合計	118,055,864	143,043,924
純資産合計	118,055,864	143,043,924
負債純資産合計	118,143,788	143,338,172

## ( 2 ) 【損益及び剰余金計算書】

( 単位：円 )

	第2期		第3期	
	自	2021年12月 1日	自	2022年12月 1日
	至	2022年11月30日	至	2023年11月30日
<b>営業収益</b>				
有価証券売買等損益		469,229		1,711,644
<b>営業収益合計</b>		<b>469,229</b>		<b>1,711,644</b>
<b>営業費用</b>				
支払利息		-		32
受託者報酬		5,635		30,993
委託者報酬		94,421		512,802
その他費用		1,206		7,600
<b>営業費用合計</b>		<b>101,262</b>		<b>551,427</b>
営業利益又は営業損失 ( )		367,967		2,263,071
経常利益又は経常損失 ( )		367,967		2,263,071
当期純利益又は当期純損失 ( )		367,967		2,263,071
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額 ( )		535,928		316,910
期首剰余金又は期首欠損金 ( )		109,599		4,915,086
剰余金増加額又は欠損金減少額		430,256		1,904,203
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		430,256		1,904,203
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		-
剰余金減少額又は欠損金増加額		6,139,638		4,932,479
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		-
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		6,139,638		4,932,479
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金 ( )		4,915,086		9,889,523

## ( 3 ) 【注記表】

## ( 重要な会計方針の注記 )

項 目	第3期	
	自 2022年12月1日 至 2023年11月30日	
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>	

## ( 重要な会計上の見積りに関する注記 )

会計上の見積りについて、翌計算期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクがある項目を識別していないため、注記を省略しております。

## ( 貸借対照表に関する注記 )

項 目	第2期	第3期
	( 2022年11月30日現在 )	( 2023年11月30日現在 )
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	122,970,950口	152,933,447口
2. 「投資信託財産の計算に関する規則」第55条の6第10号に規定する額	元本の欠損 4,915,086円	元本の欠損 9,889,523円
3. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 0.9600円 ( 1万口当たりの純資産額9,600円 )	1口当たり純資産額 0.9353円 ( 1万口当たりの純資産額9,353円 )

## ( 損益及び剰余金計算書に関する注記 )

項 目	第2期	第3期
	自 2021年12月1日 至 2022年11月30日	自 2022年12月1日 至 2023年11月30日
分配金の計算過程	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益（991,788円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（0円）、収益調整金（1,176,269円）、および分配準備積立金（3,394円）より、分配対象収益は2,171,451円（1万口当たり176.58円）であります、分配を行っておりません。</p>	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益（5,254,857円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（0円）、収益調整金（2,068,866円）、および分配準備積立金（787,828円）より、分配対象収益は8,111,551円（1万口当たり530.40円）であります、分配を行っておりません。</p>



## （金融商品に関する注記）

## ・金融商品の状況に関する事項

項 目	第3期 自 2022年12月1日 至 2023年11月30日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	(1) 金融商品の内容 1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、親投資信託受益証券を組み入れております。 2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。 3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 (2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。

<p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p>	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。なお、投資信託協会の流動性リスク管理規制に抵触する場合には、流動性リスクを管理する会議で審議の上、流動性リスクの管理責任者が対処方針を決定します。その後、決定した対処方針やその実施等について、リスク管理会議に報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>
--------------------------	--

・金融商品の時価等に関する事項

項目	第3期 (2023年11月30日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（親投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

第2期（自 2021年12月1日 至 2022年11月30日）

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	986,482円
合計	986,482円

## 第3期(自 2022年12月1日 至 2023年11月30日)

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	1,545,606円
合計	1,545,606円

## (デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

## (関連当事者との取引に関する注記)

第3期 自 2022年12月1日 至 2023年11月30日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

## (その他の注記)

項 目	第2期 (2022年11月30日現在)	第3期 (2023年11月30日現在)
期首元本額	2,251,882円	122,970,950円
期中追加設定元本額	132,574,732円	67,492,161円
期中一部解約元本額	11,855,664円	37,529,664円

## (4)【附属明細表】

## 有価証券明細表

## (a)株式

該当事項はありません。

## (b)株式以外の有価証券

(単位：円)

種 類	銘 柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受 益証券	Jリート・インデックス・マザー ファンド	54,236,752	143,336,888	
	親投資信託受益証券 小計		143,336,888	
合 計			143,336,888	

## デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 【三井住友D S ・先進国リートインデックス・ファンド】

## ( 1 ) 【貸借対照表】

( 単位：円 )

	第2期 ( 2022年11月30日現在 )	第3期 ( 2023年11月30日現在 )
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	93	22
コール・ローン	571	1,297
親投資信託受益証券	87,051,905	344,864,871
未収入金	-	966,770
流動資産合計	87,052,569	345,832,960
資産合計	87,052,569	345,832,960
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	-	966,763
未払受託者報酬	5,407	35,190
未払委託者報酬	111,767	722,218
その他未払費用	1,550	10,470
流動負債合計	118,724	1,734,641
負債合計	118,724	1,734,641
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	82,034,605	310,819,273
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 ( )	4,899,240	33,279,046
( 分配準備積立金 )	988,236	12,824,832
元本等合計	86,933,845	344,098,319
純資産合計	86,933,845	344,098,319
負債純資産合計	87,052,569	345,832,960

## ( 2 ) 【損益及び剰余金計算書】

( 単位：円 )

	第2期		第3期	
	自	2021年12月 1日	自	2022年12月 1日
	至	2022年11月30日	至	2023年11月30日
<b>営業収益</b>				
有価証券売買等損益		3,749,709		17,246,686
<b>営業収益合計</b>		<b>3,749,709</b>		<b>17,246,686</b>
<b>営業費用</b>				
支払利息		-		8
受託者報酬		6,385		44,782
委託者報酬		132,753		919,752
その他費用		1,759		13,273
<b>営業費用合計</b>		<b>140,897</b>		<b>977,815</b>
営業利益又は営業損失( )		3,890,606		16,268,871
経常利益又は経常損失( )		3,890,606		16,268,871
当期純利益又は当期純損失( )		3,890,606		16,268,871
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額( )		226,848		1,164,189
期首剰余金又は期首欠損金( )		163,300		4,899,240
剰余金増加額又は欠損金減少額		9,272,153		16,301,412
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		9,272,153		16,301,412
剰余金減少額又は欠損金増加額		872,455		3,026,288
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		872,455		3,026,288
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		-
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金( )		4,899,240		33,279,046

## (3) 【注記表】

## (重要な会計方針の注記)

項 目	第3期	
	自 2022年12月1日 至 2023年11月30日	
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>	

## (重要な会計上の見積りに関する注記)

会計上の見積りについて、翌計算期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクがある項目を識別していないため、注記を省略しております。

## (貸借対照表に関する注記)

項 目	第2期	第3期
	(2022年11月30日現在)	(2023年11月30日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	82,034,605口	310,819,273口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.0597円 (1万口当たりの純資産額10,597円)	1口当たり純資産額 1.1071円 (1万口当たりの純資産額11,071円)

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

項 目	第2期	第3期
	自 2021年12月1日 至 2022年11月30日	自 2022年12月1日 至 2023年11月30日
分配金の計算過程	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(943,319円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(5,564,859円)、および分配準備積立金(44,917円)より、分配対象収益は6,553,095円(1万口当たり798.82円)ですが、分配を行っておりません。</p>	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(7,678,972円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(4,523,275円)、収益調整金(25,767,605円)、および分配準備積立金(622,585円)より、分配対象収益は38,592,437円(1万口当たり1,241.64円)ですが、分配を行っておりません。</p>

## (金融商品に関する注記)

## . 金融商品の状況に関する事項

項 目	第3期 自 2022年12月1日 至 2023年11月30日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	(1) 金融商品の内容 1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、親投資信託受益証券を組み入れております。 2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。 3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 (2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。

<p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p>	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。なお、投資信託協会の流動性リスク管理規制に抵触する場合には、流動性リスクを管理する会議で審議の上、流動性リスクの管理責任者が対処方針を決定します。その後、決定した対処方針やその実施等について、リスク管理会議に報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>
--------------------------	--

・金融商品の時価等に関する事項

項目	第3期 (2023年11月30日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（親投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

第2期（自 2021年12月1日 至 2022年11月30日）



種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	3,516,688円
合計	3,516,688円

## 第3期(自 2022年12月1日 至 2023年11月30日)

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	16,158,141円
合計	16,158,141円

## (デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

## (関連当事者との取引に関する注記)

第3期 自 2022年12月1日 至 2023年11月30日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

## (その他の注記)

項 目	第2期 (2022年11月30日現在)	第3期 (2023年11月30日現在)
期首元本額	2,141,454円	82,034,605円
期中追加設定元本額	90,161,002円	282,784,981円
期中一部解約元本額	10,267,851円	54,000,313円

## (4)【附属明細表】

## 有価証券明細表

## (a)株式

該当事項はありません。

## (b)株式以外の有価証券

(単位：円)

種 類	銘 柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受 益証券	外国リート・インデックス・マザー ファンド	116,701,591	344,864,871	
	親投資信託受益証券 小計		344,864,871	
合 計			344,864,871	

## デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 【三井住友D S ・ゴールドインデックス・ファンド(為替ヘッジあり)】

## ( 1 ) 【貸借対照表】

( 単位 : 円 )

	第2期 ( 2022年11月30日現在 )	第3期 ( 2023年11月30日現在 )
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	14,969	7,869
コール・ローン	92,363	472,502
親投資信託受益証券	334,057,286	894,705,584
派生商品評価勘定	1,316,791	19,645,875
未収入金	1,069,582	2,082,964
流動資産合計	336,550,991	916,914,794
資産合計	336,550,991	916,914,794
<b>負債の部</b>		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	31,517
未払解約金	572,472	468,680
未払受託者報酬	27,736	89,714
未払委託者報酬	458,109	1,480,999
その他未払費用	10,342	42,440
流動負債合計	1,068,659	2,113,350
負債合計	1,068,659	2,113,350
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	361,645,871	906,115,613
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	26,163,539	8,685,831
( 分配準備積立金 )	-	21,906,418
元本等合計	335,482,332	914,801,444
純資産合計	335,482,332	914,801,444
負債純資産合計	336,550,991	916,914,794

## ( 2 ) 【損益及び剰余金計算書】

( 単位：円 )

	第2期		第3期	
	自	2021年12月 1日	自	2022年12月 1日
	至	2022年11月30日	至	2023年11月30日
<b>営業収益</b>				
受取利息		-		4
有価証券売買等損益		12,605,879		136,205,282
為替差損益		28,689,850		95,196,159
<b>営業収益合計</b>		<b>16,083,971</b>		<b>41,009,127</b>
<b>営業費用</b>				
支払利息		-		109
受託者報酬		35,110		142,015
委託者報酬		580,576		2,344,576
その他費用		16,282		48,380
<b>営業費用合計</b>		<b>631,968</b>		<b>2,535,080</b>
営業利益又は営業損失 ( )		16,715,939		38,474,047
経常利益又は経常損失 ( )		16,715,939		38,474,047
当期純利益又は当期純損失 ( )		16,715,939		38,474,047
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額 ( )		229,995		3,143,371
期首剰余金又は期首欠損金 ( )		972,728		26,163,539
剰余金増加額又は欠損金減少額		-		5,988,065
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		5,988,065
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		-
剰余金減少額又は欠損金増加額		8,704,867		6,469,371
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		1,338,189		-
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		7,366,678		6,469,371
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金 ( )		26,163,539		8,685,831

## ( 3 ) 【注記表】

## ( 重要な会計方針の注記 )

項 目	第3期	
	自 2022年12月1日 至 2023年11月30日	
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>	
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>	

## ( 重要な会計上の見積りに関する注記 )

会計上の見積りについて、翌計算期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクがある項目を識別していないため、注記を省略しております。

## ( 貸借対照表に関する注記 )

項 目	第2期	第3期
	( 2022年11月30日現在 )	( 2023年11月30日現在 )
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	361,645,871口	906,115,613口
2. 「投資信託財産の計算に関する規則」第55条の6第10号に規定する額	元本の欠損 26,163,539円	元本の欠損
3. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 0.9277円 ( 1万口当たりの純資産額9,277円 )	1口当たり純資産額 1.0096円 ( 1万口当たりの純資産額10,096円 )

## ( 損益及び剰余金計算書に関する注記 )

項 目	第2期	第3期
	自 2021年12月1日 至 2022年11月30日	自 2022年12月1日 至 2023年11月30日

分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益(0円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(0円)、および分配準備積立金(0円)より、分配対象収益は0円(1万口当たり0.00円)ですが、分配を行っておりません。	計算期間末における費用控除後の配当等収益(4,172円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(21,902,246円)、収益調整金(0円)、および分配準備積立金(0円)より、分配対象収益は21,906,418円(1万口当たり241.76円)ですが、分配を行っておりません。
----------	---	---

## (金融商品に関する注記)

## . 金融商品の状況に関する事項

項 目	第3期 自 2022年12月1日 至 2023年11月30日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、親投資信託受益証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。 当計算期間については、為替予約取引を行っております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>

<p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p>	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。なお、投資信託協会の流動性リスク管理規制に抵触する場合には、流動性リスクを管理する会議で審議の上、流動性リスクの管理責任者が対処方針を決定します。その後、決定した対処方針やその実施等について、リスク管理会議に報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>
--------------------------	--

・金融商品の時価等に関する事項

項目	第3期 (2023年11月30日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（親投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

第2期（自 2021年12月1日 至 2022年11月30日）

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	7,924,408円
合計	7,924,408円

## 第3期(自 2022年12月1日 至 2023年11月30日)

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	115,668,330円
合計	115,668,330円

(デリバティブ取引に関する注記)

## 第2期(2022年11月30日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位:円)

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			う ち 1 年 超		
市場取引以 外の取引	為替予約取引 売建				
	アメリカ・ドル	327,357,536	-	326,040,745	1,316,791
	小計	327,357,536	-	326,040,745	1,316,791
合 計		327,357,536	-	326,040,745	1,316,791

## 第3期(2023年11月30日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位:円)

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			う ち 1 年 超		
市場取引以 外の取引	為替予約取引 買建				
	アメリカ・ドル	1,934,766	-	1,903,249	31,517
	小計	1,934,766	-	1,903,249	31,517
	売建				
	アメリカ・ドル	904,949,653	-	885,303,778	19,645,875
	小計	904,949,653	-	885,303,778	19,645,875
合 計		906,884,419	-	887,207,027	19,614,358

(注) 1. 時価の算定方法

為替予約取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

1) 計算期間末日に対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。

計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

- ・計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、発表されている対顧客先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの対顧客先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。
  - ・計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い受渡日として、発表されている対顧客先物相場の仲値を用いております。
- 2) 計算期間末日において対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については、計算期間末日の対顧客相場の仲値で評価しております。
- 3) 上記の算定方法にて、適正な時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認められた価額で評価しております。
2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

<p>第3期 自 2022年12月1日 至 2023年11月30日</p>
<p>市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。</p>

（その他の注記）

項 目	第2期 (2022年11月30日現在)	第3期 (2023年11月30日現在)
期首元本額	38,535,757円	361,645,871円
期中追加設定元本額	379,344,235円	701,752,986円
期中一部解約元本額	56,234,121円	157,283,244円

（4）【附属明細表】

有価証券明細表

(a) 株式

該当事項はありません。

(b) 株式以外の有価証券

（単位：円）

種 類	銘 柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受 益証券	ゴールド・インデックス・マザー ファンド	611,848,174	894,705,584	
	親投資信託受益証券 小計		894,705,584	
合 計			894,705,584	

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

（参考）

「三井住友DS・TOPIXインデックス・ファンド」、「三井住友DS・日経225インデックス・ファンド」、「三井住友DS・先進国株式インデックス・ファンド」、「三井住友DS・新興国株式インデックス・ファンド」、「三井住友DS・先進国債インデックス・ファンド」、「三井住友DS・新興国債インデックス・ファンド」、「三井住友DS・国内リートインデックス・ファンド」、「三井住友D



S・先進国リートインデックス・ファンド」および「三井住友D S・ゴールドインデックス・ファンド(為替ヘッジあり)」は、「国内株式インデックス・マザーファンド(B号)」、「225マザーファンド」、「外国株式インデックス・マザーファンド」、「エマージング株式インデックス・マザーファンド」、「外国債券パッシブ・マザーファンド」、「米ドル建て新興国債インデックス・マザーファンド」、「Jリート・インデックス・マザーファンド」、「外国リート・インデックス・マザーファンド」および「ゴールド・インデックス・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同マザーファンドの受益証券です。

なお、以下に記載した状況は、監査の対象外です。

## 国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

### (1) 貸借対照表

(単位:円)

	(2022年11月30日現在)	(2023年11月30日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	456,457,514	57,867,611
コール・ローン	2,816,383,083	3,474,802,611
株式	218,143,627,430	277,901,462,330
派生商品評価勘定	205,303,100	134,548,100
未収入金	209,436,600	464,384,900
未収配当金	1,741,212,622	2,036,482,133
差入委託証拠金	186,390,000	228,352,524
流動資産合計	223,758,810,349	284,297,900,209
資産合計	223,758,810,349	284,297,900,209
<b>負債の部</b>		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	2,922,600
前受金	210,290,000	107,700,000
未払金	124,125,858	395,461,400
未払解約金	605,043,303	1,152,851,240
その他未払費用	10,581	6,886
流動負債合計	939,469,742	1,658,942,126
負債合計	939,469,742	1,658,942,126
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	65,393,298,021	67,612,101,406
剰余金		
剰余金又は欠損金( )	157,426,042,586	215,026,856,677
元本等合計	222,819,340,607	282,638,958,083
純資産合計	222,819,340,607	282,638,958,083
負債純資産合計	223,758,810,349	284,297,900,209

### (2) 注記表

#### (重要な会計方針の注記)

項 目	自 2022年12月1日 至 2023年11月30日

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(ただし、売気配相場は使用しない)、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場によっております。</p>

## (重要な会計上の見積りに関する注記)

会計上の見積りについて、翌計算期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクがある項目を識別していないため、注記を省略しております。

## (貸借対照表に関する注記)

項目	(2022年11月30日現在)	(2023年11月30日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	65,393,298,021口	67,612,101,406口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 3.4074円 (1万口当たりの純資産額34,074円)	1口当たり純資産額 4.1803円 (1万口当たりの純資産額41,803円)

## (金融商品に関する注記)

## ・金融商品の状況に関する事項

項目	自 2022年12月1日 至 2023年11月30日
1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。</p>
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、株式を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。</p> <p>当計算期間については、先物取引を行っております。</p>

	<p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク</p> <p>有価証券およびデリバティブ取引等</p> <p>当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>
<p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p>	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。なお、投資信託協会の流動性リスク管理規制に抵触する場合には、流動性リスクを管理する会議で審議の上、流動性リスクの管理責任者が対処方針を決定します。その後、決定した対処方針やその実施等について、リスク管理会議に報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド(外部ファンド)を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>

### ・金融商品の時価等に関する事項

項目	(2023年11月30日現在)
<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額</p>	<p>金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p>
<p>2. 時価の算定方法</p>	<p>(1) 有価証券(株式)</p> <p>「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引)</p> <p>デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。
----------------------------	--

## (デリバティブ取引に関する注記)

(2022年11月30日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち 1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建				
	TOPIX 先物 0412月	4,351,796,900	-	4,557,100,000	205,303,100
	小計	4,351,796,900	-	4,557,100,000	205,303,100
合計		4,351,796,900	-	4,557,100,000	205,303,100

(2023年11月30日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち 1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建				
	TOPIX 先物 0512月	4,501,574,500	-	4,633,200,000	131,625,500
	小計	4,501,574,500	-	4,633,200,000	131,625,500
合計		4,501,574,500	-	4,633,200,000	131,625,500

## (注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

- 1) 原則として計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しております。  
このような時価が発表されていない場合には、計算期間末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。
- 2) 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

## 2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

## (関連当事者との取引に関する注記)

<p style="text-align: center;">自 2022年12月1日 至 2023年11月30日</p>
<p>市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。</p>

## (その他の注記)

(2022年11月30日現在)
-----------------

開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	61,173,269,127円
同期中における追加設定元本額	11,653,465,066円
同期中における一部解約元本額	7,433,436,172円
2022年11月30日現在の元本の内訳	
三井住友・日本株式インデックス年金ファンド	9,574,760,676円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	1,036,137,254円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	4,637,683,641円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	3,605,989,911円
S M A M・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	147,542,223円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020(4資産タイプ)	4,234,860円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025(4資産タイプ)	19,508,324円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2030(4資産タイプ)	63,979,125円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2035(4資産タイプ)	165,870,052円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040(4資産タイプ)	149,775,143円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045(4資産タイプ)	266,593,539円
国内株式指数ファンド(T O P I X)	1,398,015,768円
三井住友・DCつみたてN I S A・日本株インデックスファンド	22,016,808,347円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	179,974,667円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	253,617,658円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	167,938,880円
イオン・バランス戦略ファンド	20,272,782円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2050	41,931,085円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	191,067,731円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	178,416,019円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	669,872,498円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	375,434,831円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	427,891,807円
三井住友・DCつみたてN I S A・世界分散ファンド	49,851,584円
三井住友D S・国内株式インデックス年金ファンド	813,757,842円
三井住友D S・年金バランス30(債券重点型)	39,664,361円
三井住友D S・年金バランス50(標準型)	202,349,704円
三井住友D S・年金バランス70(株式重点型)	191,586,051円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2060	5,500,206円
日興F W S・日本株インデックス	1,276,658,198円
三井住友D S・T O P I Xインデックス・ファンド	18,140,230円
S M A M・国内株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	2,564,092,115円
バランスファンドV A(安定運用型) <適格機関投資家限定>	11,882,906円
S M A M・バランスファンドV A安定成長型 <適格機関投資家限定>	74,050,540円
S M A M・バランスファンドV A 2 5 <適格機関投資家専用>	1,456,182,387円
S M A M・バランスファンドV A 3 7 . 5 <適格機関投資家専用>	1,446,188,375円
S M A M・バランスファンドV A 5 0 <適格機関投資家専用>	5,623,103,466円
S M A M・バランスファンドV L 3 0 <適格機関投資家限定>	37,493,396円
S M A M・バランスファンドV L 5 0 <適格機関投資家限定>	135,694,110円
S M A M・バランスファンドV A 7 5 <適格機関投資家専用>	684,565,549円
S M A M・バランスファンドV L 国際分散型 <適格機関投資家限定>	44,118,775円
S M A M・インデックス・バランスV A 2 5 <適格機関投資家専用>	254,234,553円

S M A M ・ インデックス ・ バランス V A 5 0 < 適格機関投資家専用 >	796,235,497円
S M A M ・ バランスファンド V A 4 0 < 適格機関投資家専用 >	533,449,238円
S M A M ・ バランスファンド V A 3 5 < 適格機関投資家専用 >	1,657,079,267円
S M A M ・ バランス V A 株 4 0 T < 適格機関投資家限定 >	372,784円
S M A M ・ グローバルバランス 4 0 V A < 適格機関投資家限定 >	36,667,207円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 2 0 A < 適格機関投資家専用 >	39,482,192円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 3 5 A < 適格機関投資家専用 >	32,479,210円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 5 0 A < 適格機関投資家専用 >	16,795,425円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 2 0 L < 適格機関投資家専用 >	95,429,547円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 2 5 L < 適格機関投資家専用 >	219,105,114円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 2 0 A 2 < 適格機関投資家専用 >	52,522,560円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 3 5 A 2 < 適格機関投資家専用 >	38,723,328円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 5 0 A 2 < 適格機関投資家専用 >	7,680,964円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 3 0 L 2 < 適格機関投資家専用 >	41,326,285円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 2 5 L 2 < 適格機関投資家専用 >	542,525,688円
S M A M ・ 国内株式インデックスファンド ・ V A ( 適格機関投資家専用 )	167,317,059円
S M A M ・ グローバルバランスファンド ( 標準型 ) V A < 適格機関投資家限定 >	202,591,112円
S M A M ・ グローバルバランスファンド ( 債券重視型 ) V A < 適格機関投資家限定 >	85,721,825円
S M A M ・ 世界バランスファンド V A < 適格機関投資家限定 >	94,168,528円
S M A M ・ 世界バランスファンド V A 2 < 適格機関投資家限定 >	44,811,453円
S M A M ・ 年金 W リスクコントロールファンド < 適格機関投資家限定 >	42,807,427円
S M A M ・ マルチアセットストラテジーファンド 2 0 1 6 - 0 4 < 適格機関投資家限定 >	5,577,900円
S M A M ・ マルチアセットストラテジー ・ オープン < 適格機関投資家限定 >	7,187,543円
S M A M ・ マルチアセット ・ ダイナミックアロケーション ・ ストラテジー ・ ファンド < 適格機関投資家限定 >	92,673,351円
S M D A M ・ 日米 3 資産バランスオープン < 適格機関投資家限定 >	18,136,348円
合 計	65,393,298,021円

( 2023年11月30日現在 )

## 開示対象ファンドの

期首における当該親投資信託の元本額	65,393,298,021円
同期中における追加設定元本額	11,963,349,687円
同期中における一部解約元本額	9,744,546,302円

## 2023年11月30日現在の元本の内訳

三井住友 ・ 日本株式インデックス年金ファンド	9,698,799,980円
三井住友 ・ D C 年金バランス 3 0 ( 債券重点型 )	1,001,422,929円
三井住友 ・ D C 年金バランス 5 0 ( 標準型 )	4,466,421,362円
三井住友 ・ D C 年金バランス 7 0 ( 株式重点型 )	3,671,641,660円
S M A M ・ グローバルバランスファンド ( 機動的資産配分型 )	136,038,750円
三井住友 ・ D C ターゲットイヤーファンド 2 0 2 0 ( 4 資産タイプ )	3,406,393円
三井住友 ・ D C ターゲットイヤーファンド 2 0 2 5 ( 4 資産タイプ )	15,296,763円
三井住友 ・ D C ターゲットイヤーファンド 2 0 3 0 ( 4 資産タイプ )	54,752,270円
三井住友 ・ D C ターゲットイヤーファンド 2 0 3 5 ( 4 資産タイプ )	159,640,709円
三井住友 ・ D C ターゲットイヤーファンド 2 0 4 0 ( 4 資産タイプ )	149,414,525円
三井住友 ・ D C ターゲットイヤーファンド 2 0 4 5 ( 4 資産タイプ )	271,748,343円
国内株式指数ファンド ( T O P I X )	1,365,075,520円

三井住友・DCつみたてN I S A・日本株インデックスファンド	26,260,180,571円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	115,624,640円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	168,156,238円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	103,225,362円
イオン・バランス戦略ファンド	37,149,436円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2050	50,643,471円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	208,010,508円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	197,543,121円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	777,703,738円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	448,368,315円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	525,557,954円
三井住友・DCつみたてN I S A・世界分散ファンド	55,602,276円
三井住友D S・国内株式インデックス年金ファンド	1,154,657,014円
三井住友D S・年金バランス30(債券重点型)	39,519,295円
三井住友D S・年金バランス50(標準型)	236,791,813円
三井住友D S・年金バランス70(株式重点型)	240,914,837円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2060	5,981,135円
日興FWS・日本株インデックス	1,902,897,918円
三井住友D S・T O P I Xインデックス・ファンド	68,065,303円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2035	691,428円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2040	482,039円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2045	427,244円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2055	135,914円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2065	230,889円
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル1(保守型)	554,713円
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル2(安定型)	7,852,953円
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル3(安定成長型)	34,809,759円
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル4(成長型)	20,073,130円
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル5(積極成長型)	8,796,845円
S M A M・国内株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	2,397,731,905円
バランスファンドV A(安定運用型) < 適格機関投資家限定 >	7,994,782円
S M A M・バランスファンドV A安定成長型 < 適格機関投資家限定 >	47,143,831円
S M A M・バランスファンドV A 2 5 < 適格機関投資家専用 >	965,486,618円
S M A M・バランスファンドV A 3 7 . 5 < 適格機関投資家専用 >	1,166,398,533円
S M A M・バランスファンドV A 5 0 < 適格機関投資家専用 >	4,510,477,578円
S M A M・バランスファンドV L 3 0 < 適格機関投資家限定 >	29,416,152円
S M A M・バランスファンドV L 5 0 < 適格機関投資家限定 >	108,603,049円
S M A M・バランスファンドV A 7 5 < 適格機関投資家専用 >	590,105,352円
S M A M・バランスファンドV L 国際分散型 < 適格機関投資家限定 >	35,412,893円
S M A M・インデックス・バランスV A 2 5 < 適格機関投資家専用 >	195,641,630円
S M A M・インデックス・バランスV A 5 0 < 適格機関投資家専用 >	641,083,284円
S M A M・バランスファンドV A 4 0 < 適格機関投資家専用 >	414,428,470円
S M A M・バランスファンドV A 3 5 < 適格機関投資家専用 >	1,267,607,584円
S M A M・バランスV A株40T < 適格機関投資家限定 >	314,855円
S M A M・グローバルバランス40V A < 適格機関投資家限定 >	27,021,199円
S M A M・アセットバランスファンドV A 2 0 A < 適格機関投資家専用 >	29,338,861円
S M A M・アセットバランスファンドV A 3 5 A < 適格機関投資家専用 >	25,915,474円
S M A M・アセットバランスファンドV A 5 0 A < 適格機関投資家専用 >	14,447,235円

SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	67,115,115円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	173,003,538円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	37,568,256円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	32,445,682円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	6,832,341円
SMAM・アセットバランスファンドVA30L2<適格機関投資家専用>	30,702,488円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	411,103,933円
SMAM・国内株式インデックスファンド・VA(適格機関投資家専用)	156,608,259円
SMAM・グローバルバランスファンド(標準型)VA<適格機関投資家限定>	157,255,373円
SMAM・グローバルバランスファンド(債券重視型)VA<適格機関投資家限定>	65,272,266円
SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	50,839,821円
SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定>	29,597,543円
SMAM・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	50,954,848円
SMAM・マルチアセットストラテジーファンド2016-04<適格機関投資家限定>	28,238,310円
SMAM・マルチアセットストラテジー・オープン<適格機関投資家限定>	45,469,182円
SMAM・マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンド<適格機関投資家限定>	85,247,790円
SMDAM・日米3資産バランスオープン<適格機関投資家限定>	15,940,785円
SMDAM・年金Wリスクコントロールファンド(リスク3%)<適格機関投資家限定>	29,029,528円
合計	67,612,101,406円

## (3) 附属明細表

## 有価証券明細表

## (a) 株式

(単位:円)

銘柄	株数	評価額		備考
		単価	金額	
極洋	4,100	3,830.000	15,703,000	
ニッスイ	115,600	737.400	85,243,440	
マルハニチロ	17,100	2,840.000	48,564,000	
雪国まいたけ	11,400	950.000	10,830,000	
カネコ種苗	4,700	1,422.000	6,683,400	
サカタのタネ	13,200	3,985.000	52,602,000	
ホクト	10,100	1,754.000	17,715,400	
住石ホールディングス	14,400	772.000	11,116,800	
日鉄鉱業	4,500	5,650.000	25,425,000	
三井松島ホールディングス	5,500	2,818.000	15,499,000	
INPEX	427,200	2,090.000	892,848,000	
石油資源開発	13,300	5,690.000	75,677,000	
K&Oエナジーグループ	5,500	2,189.000	12,039,500	
ショーボンドホールディングス	15,700	6,025.000	94,592,500	
ミライト・ワン	38,100	1,846.500	70,351,650	
タマホーム	7,300	3,480.000	25,404,000	
日本アクア	5,000	935.000	4,675,000	
安藤・間	66,300	1,092.000	72,399,600	



東急建設	32,300	788.000	25,452,400
コムシスホールディングス	37,500	3,207.000	120,262,500
ピーアールホールディングス	21,600	359.000	7,754,400
高松コンストラクショングループ	7,200	2,637.000	18,986,400
東建コーポレーション	3,200	8,100.000	25,920,000
ヤマウラ	6,900	1,438.000	9,922,200
オリエンタル白石	44,000	330.000	14,520,000
大成建設	75,700	5,031.000	380,846,700
大林組	288,900	1,247.500	360,402,750
清水建設	233,600	971.600	226,965,760
飛島建設	9,600	1,299.000	12,470,400
長谷工コーポレーション	83,000	1,818.500	150,935,500
松井建設	8,200	775.000	6,355,000
銭高組	1,500	3,850.000	5,775,000
鹿島建設	179,100	2,336.500	418,467,150
不動テトラ	5,600	2,189.000	12,258,400
鉄建建設	6,700	1,953.000	13,085,100
西松建設	13,900	3,914.000	54,404,600
三井住友建設	65,600	398.000	26,108,800
大豊建設	3,600	3,650.000	13,140,000
奥村組	12,900	4,515.000	58,243,500
東鉄工業	10,900	2,902.000	31,631,800
浅沼組	6,400	3,695.000	23,648,000
戸田建設	99,900	844.300	84,345,570
熊谷組	13,400	3,400.000	45,560,000
北野建設	1,900	3,100.000	5,890,000
矢作建設工業	11,500	1,286.000	14,789,000
ピーエス三菱	10,900	941.000	10,256,900
日本ハウスホールディングス	19,500	326.000	6,357,000
新日本建設	11,500	1,111.000	12,776,500
東亜道路工業	3,400	6,690.000	22,746,000
日本道路	8,500	1,897.000	16,124,500
東亜建設工業	7,100	3,575.000	25,382,500
日本国土開発	24,300	589.000	14,312,700
若築建設	3,900	2,946.000	11,489,400
東洋建設	26,300	1,330.000	34,979,000
五洋建設	114,600	810.400	92,871,840
世紀東急工業	10,800	1,664.000	17,971,200
福田組	3,100	5,220.000	16,182,000
住友林業	69,700	3,774.000	263,047,800
日本基礎技術	7,500	450.000	3,375,000
巴コーポレーション	11,500	560.000	6,440,000
大和ハウス工業	223,500	4,199.000	938,476,500
ライト工業	14,400	1,980.000	28,512,000
積水ハウス	244,900	3,029.000	741,802,100
日特建設	8,200	1,028.000	8,429,600
ユアテック	17,800	1,003.000	17,853,400
日本リーテック	7,700	1,257.000	9,678,900

四電工	3,500	2,908.000	10,178,000
中電工	11,500	2,431.000	27,956,500
関電工	49,000	1,328.000	65,072,000
きんでん	56,500	2,219.500	125,401,750
東京エネシス	8,700	965.000	8,395,500
トーエネック	2,900	4,245.000	12,310,500
住友電設	7,400	2,557.000	18,921,800
日本電設工業	13,200	2,024.000	26,716,800
エクシオグループ	36,800	3,118.000	114,742,400
新日本空調	5,300	2,235.000	11,845,500
九電工	19,700	4,663.000	91,861,100
三機工業	16,900	1,750.000	29,575,000
日揮ホールディングス	80,000	1,661.500	132,920,000
中外炉工業	3,300	2,239.000	7,388,700
ヤマト	7,000	941.000	6,587,000
太平電業	5,000	3,875.000	19,375,000
高砂熱学工業	19,300	2,999.000	57,880,700
三晃金属工業	1,300	4,700.000	6,110,000
朝日工業社	4,000	2,798.000	11,192,000
明星工業	16,000	1,120.000	17,920,000
大気社	9,200	4,230.000	38,916,000
ダイダン	10,600	1,480.000	15,688,000
日比谷総合設備	6,900	2,358.000	16,270,200
テスホールディングス	18,200	442.000	8,044,400
インフロニア・ホールディングス	86,900	1,561.500	135,694,350
東洋エンジニアリング	11,300	706.000	7,977,800
レイズネクスト	11,400	1,388.000	15,823,200
ニッポン	21,400	2,274.000	48,663,600
日清製粉グループ本社	75,000	2,048.500	153,637,500
日東富士製粉	1,700	4,720.000	8,024,000
昭和産業	6,700	3,060.000	20,502,000
鳥越製粉	10,700	715.000	7,650,500
中部飼料	11,300	1,085.000	12,260,500
フィード・ワン	12,900	792.000	10,216,800
日本甜菜製糖	5,200	2,013.000	10,467,600
DM三井製糖ホールディングス	7,900	3,020.000	23,858,000
ウェルネオシュガー	4,700	2,064.000	9,700,800
森永製菓	15,000	5,277.000	79,155,000
中村屋	2,800	3,070.000	8,596,000
江崎グリコ	23,200	4,079.000	94,632,800
井村屋グループ	4,800	2,319.000	11,131,200
不二家	5,700	2,501.000	14,255,700
山崎製パン	54,600	3,235.000	176,631,000
モロゾフ	2,800	3,885.000	10,878,000
亀田製菓	5,100	3,885.000	19,813,500
寿スピリッツ	43,000	2,348.000	100,964,000
カルビー	37,300	2,769.000	103,283,700
森永乳業	29,600	2,760.000	81,696,000

六甲バター	6,300	1,384.000	8,719,200
ヤクルト本社	116,200	3,303.000	383,808,600
明治ホールディングス	99,500	3,423.000	340,588,500
雪印メグミルク	19,500	2,163.000	42,178,500
プリマハム	10,600	2,250.000	23,850,000
日本ハム	31,700	4,394.000	139,289,800
丸大食品	8,400	1,617.000	13,582,800
S Foods	8,900	3,205.000	28,524,500
柿安本店	3,300	2,476.000	8,170,800
伊藤ハム米久ホールディングス	12,100	3,950.000	47,795,000
サッポロホールディングス	26,700	5,766.000	153,952,200
アサヒグループホールディングス	187,500	5,455.000	1,022,812,500
キリンホールディングス	338,300	2,087.000	706,032,100
宝ホールディングス	54,800	1,215.000	66,582,000
オエノンホールディングス	26,200	374.000	9,798,800
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	63,600	2,025.500	128,821,800
ライフドリンク カンパニー	1,700	3,870.000	6,579,000
サントリー食品インターナショナル	57,100	4,648.000	265,400,800
ダイドーグループホールディングス	4,500	5,980.000	26,910,000
伊藤園	27,500	4,495.000	123,612,500
キーコーヒー	8,400	2,068.000	17,371,200
日清オイリオグループ	11,300	4,185.000	47,290,500
不二製油グループ本社	18,900	2,322.000	43,885,800
かどや製油	1,800	3,560.000	6,408,000
J - オイルミルズ	8,300	1,973.000	16,375,900
キッコーマン	53,700	9,065.000	486,790,500
味の素	195,800	5,526.000	1,081,990,800
ブルドックソース	4,700	2,092.000	9,832,400
キューピー	43,600	2,580.000	112,488,000
ハウス食品グループ本社	24,800	3,229.000	80,079,200
カゴメ	36,400	3,177.000	115,642,800
アリアケジャパン	7,200	4,615.000	33,228,000
エバラ食品工業	2,800	2,834.000	7,935,200
ニチレイ	37,300	3,224.000	120,255,200
東洋水産	41,100	7,870.000	323,457,000
イトアンドホールディングス	4,100	2,045.000	8,384,500
ヨシムラ・フード・ホールディングス	5,800	1,114.000	6,461,200
日清食品ホールディングス	28,600	14,665.000	419,419,000
永谷園ホールディングス	4,200	2,169.000	9,109,800
フジッコ	7,600	1,936.000	14,713,600
ロック・フィールド	9,100	1,591.000	14,478,100
日本たばこ産業	493,400	3,801.000	1,875,413,400
ケンコーマヨネーズ	6,300	1,615.000	10,174,500
わらべや日洋ホールディングス	6,200	3,485.000	21,607,000
なとり	5,400	2,035.000	10,989,000
ファーマフーズ	11,800	1,283.000	15,139,400
ユーグレナ	51,500	746.000	38,419,000

紀文食品	7,100	1,152.000	8,179,200
ピククルスホールディングス	5,200	1,207.000	6,276,400
ミヨシ油脂	5,200	1,465.000	7,618,000
理研ビタミン	7,200	2,253.000	16,221,600
片倉工業	9,000	1,677.000	15,093,000
グンゼ	5,900	4,800.000	28,320,000
東洋紡	36,100	1,052.000	37,977,200
ユニチカ	30,500	183.000	5,581,500
富士紡ホールディングス	3,500	3,690.000	12,915,000
倉敷紡績	6,600	2,557.000	16,876,200
シキボウ	6,100	1,093.000	6,667,300
日本毛織	21,800	1,295.000	28,231,000
帝国繊維	9,300	2,029.000	18,869,700
帝人	79,700	1,345.500	107,236,350
東レ	554,100	767.100	425,050,110
ダイニック	6,300	725.000	4,567,500
セーレン	16,000	2,320.000	37,120,000
小松マテーレ	13,300	780.000	10,374,000
ワコールホールディングス	15,300	3,255.000	49,801,500
ホギメディカル	11,200	3,425.000	38,360,000
T S Iホールディングス	28,500	774.000	22,059,000
ワールド	10,800	1,630.000	17,604,000
三陽商会	2,800	2,698.000	7,554,400
オンワードホールディングス	54,600	501.000	27,354,600
ルックホールディングス	2,600	2,483.000	6,455,800
ゴールドウイン	14,700	11,535.000	169,564,500
デサント	14,300	4,255.000	60,846,500
特種東海製紙	4,000	3,715.000	14,860,000
王子ホールディングス	344,400	549.200	189,144,480
日本製紙	43,600	1,337.000	58,293,200
北越コーポレーション	51,000	1,409.000	71,859,000
大王製紙	37,000	1,047.500	38,757,500
レンゴー	75,900	935.500	71,004,450
トーモク	5,400	2,174.000	11,739,600
ザ・パックス	6,200	3,215.000	19,933,000
北の達人コーポレーション	37,700	208.000	7,841,600
クラレ	122,300	1,504.500	184,000,350
旭化成	531,900	1,026.500	545,995,350
レゾナック・ホールディングス	79,700	2,760.000	219,972,000
住友化学	611,800	377.500	230,954,500
住友精化	3,500	5,050.000	17,675,000
日産化学	38,900	5,393.000	209,787,700
ラサ工業	3,500	2,132.000	7,462,000
クレハ	6,800	8,650.000	58,820,000
多木化学	3,300	3,160.000	10,428,000
テイカ	5,900	1,325.000	7,817,500
石原産業	14,800	1,373.000	20,320,400
日本曹達	8,800	5,340.000	46,992,000

東ソー	110,000	1,967.000	216,370,000
トクヤマ	26,600	2,401.000	63,866,600
セントラル硝子	13,300	2,719.000	36,162,700
東亜合成	41,100	1,360.000	55,896,000
大阪ソーダ	5,100	9,720.000	49,572,000
関東電化工業	16,400	830.000	13,612,000
デンカ	30,100	2,645.000	79,614,500
信越化学工業	743,100	5,212.000	3,873,037,200
堺化学工業	6,300	1,885.000	11,875,500
第一稀元素化学工業	8,000	995.000	7,960,000
エア・ウォーター	78,000	1,941.500	151,437,000
日本酸素ホールディングス	80,000	3,883.000	310,640,000
日本化学工業	3,000	2,029.000	6,087,000
日本パーカライジング	39,800	1,154.000	45,929,200
高压ガス工業	12,800	809.000	10,355,200
四国化成ホールディングス	11,000	1,747.000	19,217,000
戸田工業	2,100	1,632.000	3,427,200
ステラ ケミファ	5,000	3,245.000	16,225,000
保土谷化学工業	2,400	3,600.000	8,640,000
日本触媒	12,600	5,351.000	67,422,600
大日精化工業	5,800	2,217.000	12,858,600
カネカ	21,000	3,713.000	77,973,000
三菱瓦斯化学	63,000	2,337.500	147,262,500
三井化学	69,000	4,328.000	298,632,000
J S R	77,200	4,069.000	314,126,800
東京応化工業	13,300	9,163.000	121,867,900
大阪有機化学工業	6,800	2,669.000	18,149,200
三菱ケミカルグループ	582,500	968.500	564,151,250
K Hネオケム	13,300	2,290.000	30,457,000
ダイセル	117,400	1,421.000	166,825,400
住友ベークライト	12,200	7,061.000	86,144,200
積水化学工業	167,000	2,100.500	350,783,500
日本ゼオン	56,000	1,374.000	76,944,000
アイカ工業	20,700	3,325.000	68,827,500
U B E	42,300	2,323.500	98,284,050
積水樹脂	11,300	2,506.000	28,317,800
タキロンシーアイ	18,900	589.000	11,132,100
旭有機材	5,500	4,240.000	23,320,000
ニチバン	5,700	1,758.000	10,020,600
リケンテクノス	18,200	868.000	15,797,600
大倉工業	4,000	2,818.000	11,272,000
群栄化学工業	2,100	3,085.000	6,478,500
ミライアル	2,700	1,519.000	4,101,300
ダイキョーニシカワ	18,600	770.000	14,322,000
森六ホールディングス	4,400	2,960.000	13,024,000
恵和	6,100	1,360.000	8,296,000
日本化薬	64,000	1,350.000	86,400,000
カーリットホールディングス	8,700	945.000	8,221,500

日本精化	4,800	2,675.000	12,840,000
扶桑化学工業	7,500	4,385.000	32,887,500
トリケミカル研究所	11,000	3,510.000	38,610,000
A D E K A	30,000	2,869.500	86,085,000
日油	25,500	6,845.000	174,547,500
新日本理化	15,600	195.000	3,042,000
ハリマ化成グループ	5,800	795.000	4,611,000
花王	186,900	5,696.000	1,064,582,400
第一工業製薬	3,300	1,874.000	6,184,200
石原ケミカル	4,200	1,981.000	8,320,200
三洋化成工業	4,800	4,285.000	20,568,000
大日本塗料	10,800	981.000	10,594,800
日本ペイントホールディングス	438,600	1,104.500	484,433,700
関西ペイント	81,000	2,252.000	182,412,000
中国塗料	13,800	1,541.000	21,265,800
日本特殊塗料	5,200	1,269.000	6,598,800
藤倉化成	12,900	446.000	5,753,400
太陽ホールディングス	12,300	2,990.000	36,777,000
D I C	33,000	2,433.500	80,305,500
サカタインクス	18,300	1,307.000	23,918,100
東洋インキS Cホールディングス	17,200	2,667.000	45,872,400
富士フイルムホールディングス	156,400	8,660.000	1,354,424,000
資生堂	172,700	3,966.000	684,928,200
ライオン	108,600	1,294.000	140,528,400
高砂香料工業	5,600	3,515.000	19,684,000
マンダム	17,900	1,274.000	22,804,600
ミルボン	11,700	3,696.000	43,243,200
ファンケル	36,300	2,277.000	82,655,100
コーセー	16,800	10,465.000	175,812,000
コタ	8,000	1,572.000	12,576,000
ポーラ・オルビスホールディングス	42,600	1,558.500	66,392,100
ノエビアホールディングス	7,300	5,220.000	38,106,000
新日本製薬	5,000	1,575.000	7,875,000
I - n e	1,100	2,584.000	2,842,400
アクシージア	4,800	1,017.000	4,881,600
エステー	7,100	1,517.000	10,770,700
アグロ カネショウ	3,900	1,348.000	5,257,200
コニシ	13,700	2,582.000	35,373,400
長谷川香料	15,800	3,220.000	50,876,000
小林製薬	24,100	6,820.000	164,362,000
荒川化学工業	7,700	1,018.000	7,838,600
メック	6,700	4,045.000	27,101,500
日本高純度化学	2,400	2,500.000	6,000,000
タカラバイオ	22,200	1,222.000	27,128,400
J C U	9,200	3,950.000	36,340,000
新田ゼラチン	6,000	784.000	4,704,000
O A Tアグリオ	2,700	1,926.000	5,200,200
デクセリアルズ	23,000	4,633.000	106,559,000

アース製薬	7,400	4,780.000	35,372,000
北興化学工業	9,600	975.000	9,360,000
大成ラミック	3,500	2,934.000	10,269,000
クミアイ化学工業	33,100	1,089.000	36,045,900
日本農薬	15,900	598.000	9,508,200
アキレス	5,700	1,557.000	8,874,900
有沢製作所	14,400	1,095.000	15,768,000
日東電工	55,900	10,515.000	587,788,500
レック	12,800	994.000	12,723,200
三光合成	11,700	540.000	6,318,000
きもと	21,600	191.000	4,125,600
藤森工業	6,300	3,885.000	24,475,500
前澤化成工業	5,900	1,580.000	9,322,000
未来工業	3,200	3,145.000	10,064,000
J S P	6,000	1,783.000	10,698,000
エフピコ	15,900	2,791.000	44,376,900
天馬	6,400	2,336.000	14,950,400
信越ポリマー	14,800	1,429.000	21,149,200
東リ	20,000	338.000	6,760,000
ニフコ	29,800	3,612.000	107,637,600
バルカー	6,800	3,905.000	26,554,000
ユニ・チャーム	172,400	4,763.000	821,141,200
協和キリン	103,000	2,437.000	251,011,000
武田薬品工業	731,800	4,165.000	3,047,947,000
アステラス製薬	736,400	1,797.500	1,323,679,000
住友ファーマ	61,900	468.000	28,969,200
塩野義製薬	104,500	6,978.000	729,201,000
日本新薬	23,000	5,331.000	122,613,000
中外製薬	258,800	5,218.000	1,350,418,400
科研製薬	16,000	3,378.000	54,048,000
エーザイ	100,600	7,672.000	771,803,200
ロート製薬	82,000	3,090.000	253,380,000
小野薬品工業	177,000	2,721.000	481,617,000
久光製薬	19,500	4,618.000	90,051,000
持田製薬	11,000	3,355.000	36,905,000
参天製薬	155,000	1,399.000	216,845,000
扶桑薬品工業	4,000	1,907.000	7,628,000
ツムラ	28,000	2,795.000	78,260,000
キッセイ薬品工業	15,500	3,055.000	47,352,500
生化学工業	15,900	792.000	12,592,800
栄研化学	17,000	1,647.000	27,999,000
鳥居薬品	5,000	3,660.000	18,300,000
J C R ファーマ	28,500	1,324.000	37,734,000
東和薬品	12,700	2,470.000	31,369,000
富士製薬工業	7,900	1,560.000	12,324,000
ゼリア新薬工業	11,300	2,026.000	22,893,800
そーせいグループ	26,900	1,389.000	37,364,100
第一三共	720,400	4,000.000	2,881,600,000

杏林製薬	17,400	1,828.000	31,807,200
大幸薬品	18,100	301.000	5,448,100
ダイト	8,000	1,945.000	15,560,000
大塚ホールディングス	172,500	5,689.000	981,352,500
ペプチドリーム	45,000	1,266.500	56,992,500
あすか製薬ホールディングス	9,700	1,821.000	17,663,700
サワイグループホールディングス	20,000	4,918.000	98,360,000
日本コークス工業	83,300	122.000	10,162,600
ニチレキ	9,600	2,286.000	21,945,600
ユシロ化学工業	5,800	1,718.000	9,964,400
富士石油	22,100	365.000	8,066,500
出光興産	91,600	4,056.000	371,529,600
E N E O Sホールディングス	1,317,100	584.400	769,713,240
コスモエネルギーホールディングス	25,000	5,635.000	140,875,000
横浜ゴム	42,200	3,289.000	138,795,800
TOYO TIRE	47,400	2,454.500	116,343,300
ブリヂストン	241,600	6,098.000	1,473,276,800
住友ゴム工業	81,100	1,709.500	138,640,450
オカモト	4,100	5,450.000	22,345,000
フコク	5,000	1,402.000	7,010,000
ニッタ	8,200	3,745.000	30,709,000
住友理工	13,800	1,034.000	14,269,200
三ツ星ベルト	11,300	4,465.000	50,454,500
バンドー化学	12,700	1,560.000	19,812,000
日東紡績	10,500	4,495.000	47,197,500
A G C	74,000	5,370.000	397,380,000
日本山村硝子	2,400	1,507.000	3,616,800
日本電気硝子	33,500	3,120.000	104,520,000
オハラ	5,300	1,314.000	6,964,200
住友大阪セメント	11,800	3,608.000	42,574,400
太平洋セメント	52,600	2,777.500	146,096,500
日本ヒューム	11,000	949.000	10,439,000
日本コンクリート工業	21,500	323.000	6,944,500
三谷セキサン	4,000	4,390.000	17,560,000
アジアパイルホールディングス	18,500	704.000	13,024,000
東海カーボン	76,300	1,094.000	83,472,200
日本カーボン	4,900	4,645.000	22,760,500
東洋炭素	6,100	4,590.000	27,999,000
ノリタケカンパニーリミテド	4,800	6,940.000	33,312,000
T O T O	54,500	3,797.000	206,936,500
日本碍子	95,900	1,804.000	173,003,600
日本特殊陶業	65,200	3,433.000	223,831,600
ダントーホールディングス	5,000	959.000	4,795,000
M A R U W A	3,200	29,770.000	95,264,000
品川リフラクトリーズ	13,000	1,705.000	22,165,000
黒崎播磨	2,000	11,230.000	22,460,000
ヨータイ	6,200	1,456.000	9,027,200
東京窯業	13,600	421.000	5,725,600



フジインコーポレーテッド	22,000	2,929.000	64,438,000
ニチアス	22,000	3,155.000	69,410,000
ニチハ	10,500	2,776.000	29,148,000
日本製鉄	380,800	3,457.000	1,316,425,600
神戸製鋼所	171,000	1,731.500	296,086,500
中山製鋼所	18,000	843.000	15,174,000
合同製鐵	4,000	4,560.000	18,240,000
J F E ホールディングス	237,000	2,180.000	516,660,000
東京製鐵	24,100	1,794.000	43,235,400
共英製鋼	9,600	2,080.000	19,968,000
大和工業	15,500	7,462.000	115,661,000
東京鐵鋼	4,300	3,960.000	17,028,000
大阪製鐵	5,300	1,907.000	10,107,100
淀川製鋼所	9,300	3,905.000	36,316,500
中部鋼鉄	7,300	1,964.000	14,337,200
丸一鋼管	25,700	3,821.000	98,199,700
モリ工業	2,000	4,185.000	8,370,000
大同特殊鋼	10,700	6,827.000	73,048,900
日本冶金工業	6,200	4,180.000	25,916,000
山陽特殊製鋼	8,200	2,616.000	21,451,200
愛知製鋼	5,100	3,435.000	17,518,500
日本金属	3,600	913.000	3,286,800
大平洋金属	6,300	1,234.000	7,774,200
新日本電工	50,900	303.000	15,422,700
栗本鐵工所	4,600	3,340.000	15,364,000
三菱製鋼	5,800	1,539.000	8,926,200
日本精線	1,300	4,705.000	6,116,500
新家工業	2,000	2,893.000	5,786,000
大紀アルミニウム工業所	12,200	1,207.000	14,725,400
日本軽金属ホールディングス	23,900	1,689.000	40,367,100
三井金属鉱業	25,200	4,540.000	114,408,000
三菱マテリアル	61,800	2,434.000	150,421,200
住友金属鉱山	98,800	4,292.000	424,049,600
D O W A ホールディングス	20,500	5,256.000	107,748,000
古河機械金属	12,900	1,872.000	24,148,800
大阪チタニウムテクノロジーズ	14,400	2,902.000	41,788,800
東邦チタニウム	16,500	1,831.000	30,211,500
U A C J	12,000	3,465.000	41,580,000
C K サンエツ	2,400	3,695.000	8,868,000
古河電気工業	28,800	2,378.500	68,500,800
住友電気工業	319,000	1,834.000	585,046,000
フジクラ	99,100	1,138.500	112,825,350
S W C C	9,700	2,681.000	26,005,700
平河ヒューテック	5,500	1,364.000	7,502,000
リョービ	9,300	2,915.000	27,109,500
アーレスティ	8,500	817.000	6,944,500
A R E ホールディングス	34,600	1,909.000	66,051,400
稲葉製作所	6,200	1,486.000	9,213,200

宮地エンジニアリンググループ	4,800	3,185.000	15,288,000
トーカロ	22,100	1,438.000	31,779,800
アルファ	4,200	1,483.000	6,228,600
SUMCO	151,100	2,216.500	334,913,150
川田テクノロジーズ	2,300	7,000.000	16,100,000
RS TECHNOLOGIES	5,900	2,862.000	16,885,800
ジェイテックコーポレーション	1,200	2,040.000	2,448,000
信和	9,900	740.000	7,326,000
東洋製罐グループホールディングス	50,900	2,294.500	116,790,050
ホッカンホールディングス	5,500	1,575.000	8,662,500
横河ブリッジホールディングス	10,500	2,724.000	28,602,000
三和ホールディングス	80,400	2,121.000	170,528,400
文化シャッター	24,000	1,380.000	33,120,000
三協立山	10,700	818.000	8,752,600
アルインコ	7,600	1,022.000	7,767,200
LIXIL	130,300	1,805.500	235,256,650
ノーリツ	13,800	1,498.000	20,672,400
長府製作所	8,400	2,102.000	17,656,800
リンナイ	46,200	3,005.000	138,831,000
日東精工	13,700	564.000	7,726,800
岡部	16,500	703.000	11,599,500
ジーテクト	9,300	1,744.000	16,219,200
東プレ	14,900	2,002.000	29,829,800
高周波熱錬	14,000	1,003.000	14,042,000
東京製綱	5,700	1,380.000	7,866,000
パイオラックス	11,600	2,265.000	26,274,000
エイチワン	9,600	768.000	7,372,800
日本発条	75,100	1,125.000	84,487,500
中央発條	4,000	722.000	2,888,000
立川ブラインド工業	4,600	1,484.000	6,826,400
三益半導体工業	6,400	2,776.000	17,766,400
日本製鋼所	22,900	2,553.500	58,475,150
三浦工業	34,600	2,866.000	99,163,600
タクマ	25,200	1,632.000	41,126,400
ツガミ	18,000	1,230.000	22,140,000
オークマ	8,100	6,194.000	50,171,400
芝浦機械	8,300	3,815.000	31,664,500
アマダ	131,500	1,482.500	194,948,750
アイダエンジニアリング	16,400	870.000	14,268,000
FUJ I	35,800	2,506.000	89,714,800
牧野フライス製作所	9,100	5,800.000	52,780,000
オーエスジー	38,200	1,841.000	70,326,200
旭ダイヤモンド工業	23,100	919.000	21,228,900
D M G 森精機	50,200	2,656.500	133,356,300
ソディック	22,400	751.000	16,822,400
ディスコ	40,100	32,090.000	1,286,809,000
日東工器	4,400	1,862.000	8,192,800
日進工具	7,100	1,030.000	7,313,000

豊和工業	5,500	775.000	4,262,500
石川製作所	3,100	1,203.000	3,729,300
リケンN P R	7,000	1,960.000	13,720,000
島精機製作所	13,500	1,534.000	20,709,000
オプトラン	13,700	1,627.000	22,289,900
N C ホールディングス	2,000	1,902.000	3,804,000
イワキ	6,300	2,057.000	12,959,100
フリュー	9,200	1,232.000	11,334,400
ヤマシンフィルタ	21,800	345.000	7,521,000
日阪製作所	8,800	957.000	8,421,600
やまびこ	13,300	1,486.000	19,763,800
野村マイクロ・サイエンス	2,800	11,430.000	32,004,000
平田機工	4,000	6,380.000	25,520,000
P E G A S U S	11,000	478.000	5,258,000
マルマエ	4,300	1,826.000	7,851,800
タツモ	5,200	3,640.000	18,928,000
ナブテスコ	52,100	2,767.500	144,186,750
三井海洋開発	10,600	1,907.000	20,214,200
レオン自動機	9,100	1,562.000	14,214,200
S M C	25,200	74,450.000	1,876,140,000
ホソカワミクロン	5,700	4,250.000	24,225,000
ユニオンツール	3,600	3,385.000	12,186,000
瑞光	6,500	1,433.000	9,314,500
オイレス工業	11,100	1,954.000	21,689,400
日精エー・エス・ビー機械	3,400	4,985.000	16,949,000
サトーホールディングス	11,600	2,039.000	23,652,400
技研製作所	8,100	1,858.000	15,049,800
日本エアーテック	5,100	1,400.000	7,140,000
日精樹脂工業	6,900	1,084.000	7,479,600
ワイエイシイホールディングス	2,700	2,530.000	6,831,000
小松製作所	390,000	3,772.000	1,471,080,000
住友重機械工業	48,900	3,529.000	172,568,100
日立建機	33,000	3,835.000	126,555,000
日工	12,800	673.000	8,614,400
巴工業	3,800	2,876.000	10,928,800
井関農機	8,400	1,106.000	9,290,400
T O W A	8,400	7,060.000	59,304,000
ローツェ	4,300	14,560.000	62,608,000
クボタ	436,600	2,119.000	925,155,400
荏原実業	4,500	2,952.000	13,284,000
三菱化工機	2,900	3,285.000	9,526,500
月島ホールディングス	11,500	1,328.000	15,272,000
帝国電機製作所	5,900	3,015.000	17,788,500
新東工業	16,700	1,087.000	18,152,900
澁谷工業	8,000	2,537.000	20,296,000
アイチコーポレーション	11,800	933.000	11,009,400
小森コーポレーション	19,300	1,169.000	22,561,700
鶴見製作所	6,300	3,565.000	22,459,500

酒井重工業	1,400	5,870.000	8,218,000
荏原製作所	34,000	8,371.000	284,614,000
西島製作所	7,600	2,197.000	16,697,200
北越工業	8,700	2,249.000	19,566,300
ダイキン工業	99,200	22,155.000	2,197,776,000
オルガノ	11,500	6,060.000	69,690,000
トーヨーカネツ	3,400	3,715.000	12,631,000
栗田工業	46,500	5,238.000	243,567,000
椿本チエイン	11,500	3,775.000	43,412,500
大同工業	6,300	737.000	4,643,100
木村化工機	8,700	716.000	6,229,200
アネスト岩田	14,100	1,094.000	15,425,400
ダイフク	134,800	2,783.000	375,148,400
サムコ	2,300	4,785.000	11,005,500
加藤製作所	4,300	1,247.000	5,362,100
タダノ	47,500	1,154.500	54,838,750
フジテック	24,600	3,429.000	84,353,400
C K D	23,900	2,409.000	57,575,100
平和	27,700	2,104.000	58,280,800
理想科学工業	7,200	2,761.000	19,879,200
S A N K Y O	19,200	6,388.000	122,649,600
日本金銭機械	9,900	1,121.000	11,097,900
マースグループホールディングス	5,100	2,383.000	12,153,300
フクシマガリレイ	6,100	4,900.000	29,890,000
ダイコク電機	4,700	3,455.000	16,238,500
竹内製作所	15,100	4,325.000	65,307,500
アマノ	23,600	3,147.000	74,269,200
J U K I	13,700	505.000	6,918,500
ジャノメ	9,400	717.000	6,739,800
マックス	10,500	2,814.000	29,547,000
グローリー	20,100	2,770.000	55,677,000
新晃工業	8,200	2,479.000	20,327,800
大和冷機工業	12,400	1,442.000	17,880,800
セガサミーホールディングス	70,300	2,147.500	150,969,250
T P R	9,300	1,729.000	16,079,700
ツバキ・ナカシマ	19,100	742.000	14,172,200
ホシザキ	49,700	4,709.000	234,037,300
大豊工業	8,300	873.000	7,245,900
日本精工	140,000	775.100	108,514,000
N T N	163,400	276.900	45,245,460
ジェイテクト	73,400	1,355.500	99,493,700
不二越	6,300	3,785.000	23,845,500
日本トムソン	20,600	590.000	12,154,000
T H K	47,800	2,953.500	141,177,300
ユーシン精機	7,700	672.000	5,174,400
前澤給装工業	6,300	1,291.000	8,133,300
イーグル工業	9,300	1,657.000	15,410,100
前澤工業	5,600	979.000	5,482,400

日本ピラー工業	7,800	4,600.000	35,880,000
キッツ	30,000	1,143.000	34,290,000
マキタ	97,900	3,924.000	384,159,600
三井E & S	40,700	543.000	22,100,100
日立造船	68,100	901.000	61,358,100
三菱重工業	145,300	8,268.000	1,201,340,400
I H I	60,000	2,856.000	171,360,000
スター精密	15,100	1,877.000	28,342,700
日清紡ホールディングス	65,200	1,086.500	70,839,800
イビデン	43,700	7,071.000	309,002,700
コニカミノルタ	186,200	467.900	87,122,980
ブラザー工業	111,300	2,496.000	277,804,800
ミネベアミツミ	144,400	2,813.000	406,197,200
日立製作所	400,000	10,285.000	4,114,000,000
三菱電機	916,000	2,009.000	1,840,244,000
富士電機	50,600	6,201.000	313,770,600
東洋電機製造	5,000	936.000	4,680,000
安川電機	91,500	5,673.000	519,079,500
シンフォニア テクノロジー	10,000	2,064.000	20,640,000
明電舎	12,500	2,447.000	30,587,500
オリジン	3,500	1,216.000	4,256,000
山洋電気	3,600	6,090.000	21,924,000
デンヨー	6,900	2,160.000	14,904,000
PHCホールディングス	11,600	1,485.000	17,226,000
KOKUSAI ELECTRIC	32,000	3,315.000	106,080,000
ソシオネクスト	12,000	13,250.000	159,000,000
東芝テック	11,300	2,909.000	32,871,700
芝浦メカトロニクス	4,500	6,700.000	30,150,000
マブチモーター	20,700	4,648.000	96,213,600
ニデック	183,900	5,604.000	1,030,575,600
トレックス・セミコンダクター	4,100	2,004.000	8,216,400
東光高岳	5,300	2,069.000	10,965,700
ダブル・スコープ	24,100	920.000	22,172,000
ダイヘン	7,400	5,830.000	43,142,000
ヤーマン	15,200	1,061.000	16,127,200
JVCケンウッド	67,700	767.000	51,925,900
ミマキエンジニアリング	9,000	969.000	8,721,000
I - P E X	6,200	1,824.000	11,308,800
大崎電気工業	21,500	657.000	14,125,500
オムロン	63,900	6,199.000	396,116,100
日東工業	11,200	3,590.000	40,208,000
I D E C	12,300	2,825.000	34,747,500
ジーエス・ユアサ コーポレーション	27,300	2,173.500	59,336,550
メルコホールディングス	2,400	3,460.000	8,304,000
日本電気	110,100	8,240.000	907,224,000
富士通	76,600	21,120.000	1,617,792,000
沖電気工業	37,500	956.000	35,850,000
電気興業	3,700	2,418.000	8,946,600

サンケン電気	7,700	7,555.000	58,173,500
アイホン	4,900	2,768.000	13,563,200
ルネサスエレクトロニクス	543,000	2,603.500	1,413,700,500
セイコーエプソン	106,700	2,198.000	234,526,600
ワコム	63,400	688.000	43,619,200
アルバック	19,700	6,508.000	128,207,600
アクセル	2,800	2,110.000	5,908,000
E I Z O	6,100	4,875.000	29,737,500
日本信号	19,000	957.000	18,183,000
京三製作所	19,500	476.000	9,282,000
能美防災	11,200	1,885.000	21,112,000
ホーチキ	6,700	1,653.000	11,075,100
エレコム	19,900	1,624.000	32,317,600
パナソニック ホールディングス	983,700	1,530.000	1,505,061,000
シャープ	124,500	925.600	115,237,200
アンリツ	59,000	1,283.500	75,726,500
富士通ゼネラル	23,800	2,710.000	64,498,000
ソニーグループ	582,300	12,820.000	7,465,086,000
T D K	131,700	6,870.000	904,779,000
帝国通信工業	4,100	1,964.000	8,052,400
タムラ製作所	36,200	569.000	20,597,800
アルプスアルパイン	74,600	1,295.500	96,644,300
日本電波工業	10,800	1,250.000	13,500,000
鈴木	5,500	1,234.000	6,787,000
メイコー	9,100	4,355.000	39,630,500
日本トリム	2,200	3,105.000	6,831,000
ローランド ディー . ジー .	4,600	3,615.000	16,629,000
フォスター電機	8,700	1,112.000	9,674,400
S M K	2,500	2,516.000	6,290,000
ヨコオ	7,300	1,566.000	11,431,800
ホシデン	19,300	1,808.000	34,894,400
ヒロセ電機	12,700	16,550.000	210,185,000
日本航空電子工業	16,900	2,947.000	49,804,300
T O A	10,100	1,050.000	10,605,000
マクセル	17,400	1,658.000	28,849,200
古野電気	11,500	1,810.000	20,815,000
スミダコーポレーション	11,300	1,182.000	13,356,600
アイコム	3,600	3,260.000	11,736,000
リオン	3,800	2,229.000	8,470,200
横河電機	91,100	2,801.000	255,171,100
新電元工業	3,400	3,055.000	10,387,000
アズビル	57,600	4,772.000	274,867,200
東亜ディーケーケー	6,000	880.000	5,280,000
日本光電工業	36,700	3,712.000	136,230,400
チノー	4,000	2,066.000	8,264,000
日本電子材料	6,200	1,572.000	9,746,400
堀場製作所	16,100	9,957.000	160,307,700
アドバンテスト	236,300	4,681.000	1,106,120,300

エスペック	7,100	2,362.000	16,770,200
キーエンス	82,400	63,350.000	5,220,040,000
日置電機	4,100	6,560.000	26,896,000
シスメックス	71,000	8,181.000	580,851,000
日本マイクロニクス	14,800	3,835.000	56,758,000
メガチップス	6,800	4,230.000	28,764,000
O B A R A G R O U P	4,900	3,700.000	18,130,000
コーセル	10,600	1,264.000	13,398,400
イリソ電子工業	7,600	3,975.000	30,210,000
オプテックスグループ	15,100	1,712.000	25,851,200
千代田インテグレ	3,700	3,040.000	11,248,000
レーザーテック	37,800	33,040.000	1,248,912,000
スタンレー電気	56,500	2,736.000	154,584,000
ウシオ電機	41,800	1,905.000	79,629,000
ヘリオス テクノ ホールディング	6,300	500.000	3,150,000
日本セラミック	8,000	2,934.000	23,472,000
古河電池	6,500	892.000	5,798,000
山一電機	7,300	1,895.000	13,833,500
図研	7,200	4,240.000	30,528,000
日本電子	20,600	5,862.000	120,757,200
カシオ計算機	61,300	1,249.000	76,563,700
ファナック	402,100	4,114.000	1,654,239,400
日本シイエムケイ	19,800	751.000	14,869,800
エンプラス	2,500	13,340.000	33,350,000
大真空	10,800	848.000	9,158,400
ローム	152,400	2,825.500	430,606,200
浜松ホトニクス	66,000	5,856.000	386,496,000
三井ハイテック	7,400	7,399.000	54,752,600
新光電気工業	29,100	5,519.000	160,602,900
京セラ	128,000	8,190.000	1,048,320,000
太陽誘電	40,100	3,834.000	153,743,400
村田製作所	749,700	2,883.500	2,161,759,950
双葉電子工業	17,400	553.000	9,622,200
北陸電気工業	3,200	1,402.000	4,486,400
ニチコン	16,800	1,471.000	24,712,800
K O A	12,600	1,619.000	20,399,400
市光工業	15,900	539.000	8,570,100
小糸製作所	92,200	2,236.500	206,205,300
ミツバ	16,200	933.000	15,114,600
S C R E E Nホールディングス	28,200	10,770.000	303,714,000
キヤノン電子	9,100	1,971.000	17,936,100
キヤノン	411,300	3,807.000	1,565,819,100
リコー	206,900	1,207.000	249,728,300
象印マホービン	23,500	1,556.000	36,566,000
東京エレクトロン	174,300	24,025.000	4,187,557,500
イノテック	6,100	1,729.000	10,546,900
トヨタ紡織	34,500	2,550.000	87,975,000
ユニプレス	15,100	990.000	14,949,000

豊田自動織機	68,400	12,715.000	869,706,000
モリタホールディングス	14,600	1,526.000	22,279,600
三櫻工業	14,000	873.000	12,222,000
デンソー	679,600	2,314.000	1,572,594,400
東海理化電機製作所	22,700	2,478.000	56,250,600
川崎重工業	64,000	3,363.000	215,232,000
名村造船所	16,000	1,029.000	16,464,000
日本車輛製造	5,000	2,094.000	10,470,000
三菱ロジスネクスト	14,000	1,324.000	18,536,000
日産自動車	1,171,200	582.900	682,692,480
いすゞ自動車	239,100	1,955.500	467,560,050
トヨタ自動車	4,527,000	2,794.500	12,650,701,500
日野自動車	106,900	477.400	51,034,060
三菱自動車工業	322,300	481.400	155,155,220
G M B	2,000	1,325.000	2,650,000
武蔵精密工業	19,800	1,614.000	31,957,200
日産車体	16,000	896.000	14,336,000
新明和工業	25,900	1,184.000	30,665,600
極東開発工業	13,300	1,900.000	25,270,000
トピー工業	7,100	2,763.000	19,617,300
ティラド	3,000	3,165.000	9,495,000
タチエス	13,200	1,760.000	23,232,000
N O K	32,200	1,885.000	60,697,000
フタバ産業	24,000	856.000	20,544,000
カヤバ	7,800	4,755.000	37,089,000
大同メタル工業	19,500	579.000	11,290,500
プレス工業	36,200	620.000	22,444,000
ミクニ	10,000	456.000	4,560,000
太平洋工業	18,400	1,397.000	25,704,800
アイシン	63,500	5,451.000	346,138,500
マツダ	272,500	1,578.500	430,141,250
今仙電機製作所	6,300	614.000	3,868,200
本田技研工業	2,010,000	1,509.000	3,033,090,000
スズキ	151,400	6,021.000	911,579,400
S U B A R U	260,900	2,621.000	683,818,900
安永	4,400	708.000	3,115,200
ヤマハ発動機	118,500	3,777.000	447,574,500
エクセディ	13,000	2,548.000	33,124,000
豊田合成	23,800	2,958.000	70,400,400
愛三工業	14,000	1,312.000	18,368,000
日本プラスト	11,000	572.000	6,292,000
ヨロズ	10,000	902.000	9,020,000
エフ・シー・シー	14,200	1,828.000	25,957,600
シマノ	33,500	22,755.000	762,292,500
テイ・エス テック	37,500	1,826.000	68,475,000
ジャムコ	4,000	1,488.000	5,952,000
テルモ	232,800	4,718.000	1,098,350,400
日機装	19,100	1,006.000	19,214,600



日本エム・ディ・エム	5,400	703.000	3,796,200
島津製作所	102,200	3,835.000	391,937,000
長野計器	6,200	2,083.000	12,914,600
ブイ・テクノロジー	4,400	2,657.000	11,690,800
東京計器	6,900	1,762.000	12,157,800
愛知時計電機	3,800	2,352.000	8,937,600
インターアクション	4,500	1,016.000	4,572,000
オーバル	7,300	486.000	3,547,800
東京精密	17,800	8,577.000	152,670,600
マニー	33,200	2,193.000	72,807,600
ニコン	119,200	1,424.500	169,800,400
トプコン	43,500	1,517.000	65,989,500
オリンパス	507,600	2,166.000	1,099,461,600
理研計器	5,100	6,630.000	33,813,000
タムロン	5,400	4,415.000	23,841,000
HOYA	164,000	16,665.000	2,733,060,000
ノーリツ鋼機	7,900	2,993.000	23,644,700
A & D ホロンホールディングス	11,900	1,870.000	22,253,000
朝日インテック	92,100	2,866.500	264,004,650
シチズン時計	78,100	867.000	67,712,700
リズム	1,700	2,491.000	4,234,700
メニコン	28,400	2,154.000	61,173,600
松風	4,000	2,673.000	10,692,000
セイコーグループ	12,800	2,505.000	32,064,000
ニプロ	69,000	1,118.000	77,142,000
スノーピーク	12,300	1,012.000	12,447,600
パラマウントベッドホールディングス	18,900	2,763.000	52,220,700
トランザクション	5,200	2,112.000	10,982,400
ニホンフラッシュ	8,600	896.000	7,705,600
前田工織	7,000	2,959.000	20,713,000
永大産業	17,800	222.000	3,951,600
アートネイチャー	9,800	790.000	7,742,000
バンダイナムコホールディングス	225,400	2,943.000	663,352,200
SHOEI	18,700	1,985.000	37,119,500
フランスベッドホールディングス	10,500	1,251.000	13,135,500
パイロットコーポレーション	12,400	4,469.000	55,415,600
萩原工業	6,300	1,591.000	10,023,300
フジシールインターナショナル	16,700	1,675.000	27,972,500
タカラトミー	37,500	2,078.500	77,943,750
広済堂ホールディングス	18,000	635.000	11,430,000
プロネクス	7,700	1,209.000	9,309,300
TOPPANホールディングス	101,200	3,464.000	350,556,800
大日本印刷	90,200	4,153.000	374,600,600
共同印刷	2,800	3,600.000	10,080,000
NISSHA	15,100	1,475.000	22,272,500
TAKARA & COMPANY	5,700	2,460.000	14,022,000
アシックス	70,200	5,290.000	371,358,000
ツツミ	2,000	2,144.000	4,288,000

ローランド	6,200	4,540.000	28,148,000
小松ウオール工業	3,300	2,927.000	9,659,100
ヤマハ	51,900	3,461.000	179,625,900
河合楽器製作所	2,400	3,155.000	7,572,000
クリナップ	10,500	696.000	7,308,000
ビジョン	53,000	1,659.000	87,927,000
キングジム	9,000	870.000	7,830,000
リンテック	16,300	2,494.000	40,652,200
イトーキ	17,100	1,320.000	22,572,000
任天堂	519,900	6,912.000	3,593,548,800
三菱鉛筆	11,800	1,888.000	22,278,400
タカラスタANDARD	15,200	1,777.000	27,010,400
コクヨ	36,500	2,302.500	84,041,250
グローブライド	6,800	2,024.000	13,763,200
オカムラ	24,900	2,131.000	53,061,900
美津濃	8,300	4,045.000	33,573,500
東京電力ホールディングス	744,200	630.900	469,515,780
中部電力	303,000	1,827.000	553,581,000
関西電力	318,100	1,971.000	626,975,100
中国電力	143,200	976.400	139,820,480
北陸電力	83,400	722.300	60,239,820
東北電力	216,300	946.900	204,814,470
四国電力	75,300	1,023.000	77,031,900
九州電力	189,600	990.600	187,817,760
北海道電力	79,500	625.800	49,751,100
沖縄電力	20,600	1,084.000	22,330,400
電源開発	67,500	2,297.500	155,081,250
エフオン	8,600	476.000	4,093,600
イーレックス	15,100	659.000	9,950,900
レノバ	22,200	1,055.000	23,421,000
東京瓦斯	174,200	3,427.000	596,983,400
大阪瓦斯	166,700	2,880.000	480,096,000
東邦瓦斯	34,600	2,635.500	91,188,300
北海道瓦斯	5,100	2,261.000	11,531,100
広島ガス	19,100	374.000	7,143,400
西部ガスホールディングス	7,800	1,873.000	14,609,400
静岡ガス	18,000	1,020.000	18,360,000
メタウォーター	9,800	2,049.000	20,080,200
S B Sホールディングス	7,200	2,507.000	18,050,400
東武鉄道	90,400	3,655.000	330,412,000
相鉄ホールディングス	27,300	2,682.500	73,232,250
東急	230,700	1,735.500	400,379,850
京浜急行電鉄	93,400	1,262.000	117,870,800
小田急電鉄	126,100	2,079.500	262,224,950
京王電鉄	43,600	4,263.000	185,866,800
京成電鉄	53,100	5,960.000	316,476,000
富士急行	10,200	4,330.000	44,166,000
東日本旅客鉄道	147,900	7,995.000	1,182,460,500

西日本旅客鉄道	102,300	5,847.000	598,148,100
東海旅客鉄道	317,500	3,550.000	1,127,125,000
西武ホールディングス	99,900	1,784.500	178,271,550
鴻池運輸	14,000	1,969.000	27,566,000
西日本鉄道	21,600	2,367.500	51,138,000
ハマキョウレックス	6,300	4,005.000	25,231,500
サカイ引越センター	7,800	2,612.000	20,373,600
近鉄グループホールディングス	82,100	4,146.000	340,386,600
阪急阪神ホールディングス	109,500	4,471.000	489,574,500
南海電気鉄道	39,300	2,802.500	110,138,250
京阪ホールディングス	45,400	3,692.000	167,616,800
神戸電鉄	2,800	2,938.000	8,226,400
名古屋鉄道	90,800	2,164.500	196,536,600
山陽電気鉄道	6,700	2,123.000	14,224,100
アルプス物流	6,700	1,613.000	10,807,100
ヤマトホールディングス	105,400	2,628.500	277,043,900
山九	20,900	5,039.000	105,315,100
丸全昭和運輸	5,000	3,740.000	18,700,000
センコーグループホールディングス	42,900	1,057.000	45,345,300
トナミホールディングス	1,900	4,630.000	8,797,000
ニッコンホールディングス	26,100	3,217.000	83,963,700
福山通運	6,200	3,665.000	22,723,000
セイノーホールディングス	47,100	2,083.000	98,109,300
神奈川中央交通	2,600	3,045.000	7,917,000
A Z - C O M丸和ホールディングス	20,000	1,501.000	30,020,000
C & F ロジホールディングス	8,300	1,511.000	12,541,300
九州旅客鉄道	58,100	3,091.000	179,587,100
S Gホールディングス	145,500	2,137.500	311,006,250
N I P P O N E X P R E S Sホールディングス	28,300	8,071.000	228,409,300
日本郵船	233,400	3,974.000	927,531,600
商船三井	178,500	4,061.000	724,888,500
川崎汽船	69,400	5,189.000	360,116,600
N Sユナイテッド海運	4,600	4,865.000	22,379,000
明海グループ	7,400	692.000	5,120,800
飯野海運	30,600	1,223.000	37,423,800
乾汽船	11,600	1,214.000	14,082,400
日本航空	201,900	2,811.000	567,540,900
A N Aホールディングス	224,600	3,052.000	685,479,200
トランコム	2,400	7,560.000	18,144,000
日新	6,500	2,510.000	16,315,000
三菱倉庫	20,000	4,431.000	88,620,000
三井倉庫ホールディングス	7,500	4,835.000	36,262,500
住友倉庫	21,500	2,439.000	52,438,500
澁澤倉庫	3,300	2,833.000	9,348,900
東陽倉庫	3,700	1,518.000	5,616,600
日本トランスシティ	16,800	622.000	10,449,600
川西倉庫	5,200	1,085.000	5,642,000

安田倉庫	6,500	1,125.000	7,312,500
上組	39,000	3,239.000	126,321,000
キムラユニティー	4,300	1,423.000	6,118,900
キューソー流通システム	6,300	902.000	5,682,600
エーアイテイー	5,400	1,664.000	8,985,600
内外トランスライン	3,500	2,519.000	8,816,500
日本コンセプト	3,300	1,683.000	5,553,900
NEC ネットズエスアイ	27,300	2,159.000	58,940,700
クロスキャット	5,200	1,127.000	5,860,400
システナ	138,200	296.000	40,907,200
デジタルアーツ	5,200	4,815.000	25,038,000
日鉄ソリューションズ	14,000	4,645.000	65,030,000
キューブシステム	5,600	1,112.000	6,227,200
コア	4,400	1,779.000	7,827,600
手間いらず	1,500	2,496.000	3,744,000
ラクーンホールディングス	8,100	681.000	5,516,100
ソリトンシステムズ	4,800	1,276.000	6,124,800
ソフトクリエイティブホールディングス	7,100	1,695.000	12,034,500
T I S	90,400	3,127.000	282,680,800
グリー	23,300	568.000	13,234,400
コーエーテクモホールディングス	51,800	1,810.500	93,783,900
三菱総合研究所	3,900	4,805.000	18,739,500
ファインデックス	8,200	952.000	7,806,400
ブレインパッド	6,600	1,024.000	6,758,400
K L a b	18,400	278.000	5,115,200
ポルトウウィンホールディングス	15,000	535.000	8,025,000
ネクソン	184,500	3,198.000	590,031,000
アイスタイル	26,400	438.000	11,563,200
エムアップホールディングス	10,800	1,018.000	10,994,400
エイチーム	6,700	684.000	4,582,800
エニグモ	12,700	383.000	4,864,100
コロプラ	31,500	609.000	19,183,500
ブロードリーフ	42,900	566.000	24,281,400
クロス・マーケティンググループ	5,000	567.000	2,835,000
デジタルハーツホールディングス	5,700	1,000.000	5,700,000
メディアドゥ	3,700	1,516.000	5,609,200
じげん	24,900	538.000	13,396,200
フィックスターズ	9,800	1,356.000	13,288,800
C A R T A H O L D I N G S	4,400	1,312.000	5,772,800
オブティム	7,200	846.000	6,091,200
セレス	3,800	915.000	3,477,000
S H I F T	5,500	34,440.000	189,420,000
ティーガイア	9,000	1,835.000	16,515,000
テクマトリックス	15,200	1,735.000	26,372,000
プロシップ	4,300	1,321.000	5,680,300
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	22,000	2,292.000	50,424,000
G M O ペイメントゲートウェイ	16,500	8,707.000	143,665,500
システムリサーチ	2,800	3,590.000	10,052,000

インターネットイニシアティブ	41,600	2,657.000	110,531,200
さくらインターネット	9,600	1,791.000	17,193,600
GMOグローバルサイン・ホールディングス	2,700	2,491.000	6,725,700
SRAホールディングス	4,400	3,595.000	15,818,000
朝日ネット	9,600	627.000	6,019,200
eBASE	12,200	806.000	9,833,200
アバントグループ	10,700	1,488.000	15,921,600
アドソル日進	3,800	1,606.000	6,102,800
フリービット	5,100	1,189.000	6,063,900
コムチュア	11,000	2,015.000	22,165,000
アイル	4,000	3,570.000	14,280,000
マークラインズ	4,700	2,765.000	12,995,500
メディカル・データ・ビジョン	12,600	694.000	8,744,400
gumi	13,100	416.000	5,449,600
テラスカイ	3,900	1,566.000	6,107,400
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	5,200	1,636.000	8,507,200
PR TIMES	2,700	1,716.000	4,633,200
ラクス	39,000	2,665.000	103,935,000
ダブルスタンダード	3,700	1,504.000	5,564,800
オープンドア	6,300	723.000	4,554,900
アカツキ	4,400	2,312.000	10,172,800
UBICOMホールディングス	3,100	1,709.000	5,297,900
カナミックネットワーク	12,600	388.000	4,888,800
チェンジホールディングス	19,600	1,560.000	30,576,000
オークネット	4,500	1,841.000	8,284,500
マクロミル	17,000	792.000	13,464,000
オロ	3,700	2,494.000	9,227,800
ユーザーローカル	3,200	1,722.000	5,510,400
マネーフォワード	18,500	4,542.000	84,027,000
SUN ASTERISK	6,200	997.000	6,181,400
プラスアルファ・コンサルティング	4,900	2,719.000	13,323,100
電算システムホールディングス	4,200	2,779.000	11,671,800
APPIER GROUP	28,400	1,640.000	46,576,000
プロトコーポレーション	10,500	1,340.000	14,070,000
野村総合研究所	177,300	4,152.000	736,149,600
日本システム技術	2,800	2,708.000	7,582,400
インテージホールディングス	9,500	1,640.000	15,580,000
インフォコム	10,600	2,452.000	25,991,200
シンプルクス・ホールディングス	13,500	2,620.000	35,370,000
HEROZ	3,000	1,379.000	4,137,000
ラクスル	20,100	1,430.000	28,743,000
メルカリ	50,100	2,829.500	141,757,950
IPS	3,000	2,016.000	6,048,000
システムサポート	3,400	1,885.000	6,409,000
イーソル	7,500	608.000	4,560,000
ウイングアーク1st	8,700	3,285.000	28,579,500

ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	2,600	1,363.000	3,543,800
サーバーワークス	1,900	3,555.000	6,754,500
Sansan	27,300	1,546.000	42,205,800
ギフトィ	7,600	1,899.000	14,432,400
メドレー	11,100	4,425.000	49,117,500
ベース	3,100	3,330.000	10,323,000
JMDC	13,700	4,314.000	59,101,800
フォーカスシステムズ	6,800	991.000	6,738,800
クレスコ	7,000	1,910.000	13,370,000
フジ・メディア・ホールディングス	79,500	1,524.000	121,158,000
オービック	27,600	22,695.000	626,382,000
ジャストシステム	11,900	3,330.000	39,627,000
TDCソフト	7,200	2,099.000	15,112,800
LINEヤフー	1,160,000	430.600	499,496,000
トレンドマイクロ	39,100	7,514.000	293,797,400
IDホールディングス	6,100	1,531.000	9,339,100
日本オラクル	15,900	11,435.000	181,816,500
アルファシステムズ	3,000	2,794.000	8,382,000
フューチャー	18,500	1,804.000	33,374,000
CAC HOLDINGS	5,300	1,788.000	9,476,400
SBテクノロジー	3,700	2,494.000	9,227,800
オービックビジネスコンサルタント	12,300	6,759.000	83,135,700
アイティフォー	11,500	1,164.000	13,386,000
東計電算	1,400	7,050.000	9,870,000
大塚商会	40,800	6,035.000	246,228,000
サイボウズ	11,600	2,082.000	24,151,200
電通国際情報サービス	10,000	4,920.000	49,200,000
ACCESS	10,400	731.000	7,602,400
デジタルガレージ	14,700	3,095.000	45,496,500
イーエムシステムズ	14,500	711.000	10,309,500
ウェザーニューズ	2,500	5,870.000	14,675,000
CIJ	14,700	618.000	9,084,600
ビジネスエンジニアリング	1,500	4,420.000	6,630,000
WOWOW	7,000	1,089.000	7,623,000
スカラ	8,700	765.000	6,655,500
ANYCOLOR	3,000	3,850.000	11,550,000
IMAGICA GROUP	8,000	627.000	5,016,000
ネットワンシステムズ	30,900	2,056.000	63,530,400
アルゴグラフィックス	7,500	3,735.000	28,012,500
マーベラス	14,200	697.000	9,897,400
エイベックス	14,200	1,392.000	19,766,400
BIPROGY	27,000	4,273.000	115,371,000
都築電気	4,500	2,093.000	9,418,500
TBSホールディングス	42,300	2,746.500	116,176,950
日本テレビホールディングス	72,900	1,441.000	105,048,900
朝日放送グループホールディングス	9,600	643.000	6,172,800
テレビ朝日ホールディングス	19,900	1,675.000	33,332,500

スカパーJ S A Tホールディングス	73,700	678.000	49,968,600
テレビ東京ホールディングス	6,000	2,990.000	17,940,000
日本BS放送	6,500	887.000	5,765,500
ビジョン	12,600	1,162.000	14,641,200
USEN-NEXT HOLDINGS	9,300	3,775.000	35,107,500
日本通信	78,500	227.000	17,819,500
日本電信電話	24,550,000	173.100	4,249,605,000
KDDI	637,000	4,625.000	2,946,125,000
ソフトバンク	1,326,000	1,798.500	2,384,811,000
光通信	8,900	22,990.000	204,611,000
エムティーアイ	8,200	602.000	4,936,400
GMOインターネットグループ	30,600	2,376.500	72,720,900
ファイバーゲート	5,000	961.000	4,805,000
KADOKAWA	43,600	2,664.000	116,150,400
学研ホールディングス	14,400	977.000	14,068,800
ゼンリン	14,500	894.000	12,963,000
アイネット	5,700	1,900.000	10,830,000
松竹	4,700	9,378.000	44,076,600
東宝	46,000	5,131.000	236,026,000
東映	2,300	17,720.000	40,756,000
NTTデータグループ	222,500	1,797.000	399,832,500
ピー・シー・エー	5,200	1,173.000	6,099,600
ビジネスブレイン太田昭和	3,900	2,138.000	8,338,200
DTS	17,200	3,515.000	60,458,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	39,200	5,132.000	201,174,400
シーイーシー	11,700	1,795.000	21,001,500
カプコン	74,500	4,983.000	371,233,500
アイ・エス・ビー	4,600	1,503.000	6,913,800
ジャステック	5,500	1,463.000	8,046,500
SCSK	58,000	2,724.000	157,992,000
NSW	3,300	2,935.000	9,685,500
アイネス	6,300	1,666.000	10,495,800
TKC	12,700	3,540.000	44,958,000
富士ソフト	17,200	5,990.000	103,028,000
NSD	29,000	2,800.000	81,200,000
コナミグループ	32,100	7,315.000	234,811,500
福井コンピュータホールディングス	6,500	2,643.000	17,179,500
JBCホールディングス	6,200	3,175.000	19,685,000
ミロク情報サービス	7,900	1,737.000	13,722,300
ソフトバンクグループ	406,000	6,020.000	2,444,120,000
高千穂交易	2,700	3,400.000	9,180,000
伊藤忠食品	2,000	7,160.000	14,320,000
エレマテック	8,000	1,767.000	14,136,000
あらた	6,600	6,250.000	41,250,000
トーマンデバイス	1,400	5,300.000	7,420,000
東京エレクトロン デバイス	9,600	4,875.000	46,800,000
円谷フィールズホールディングス	15,100	1,126.000	17,002,600
双日	96,400	3,293.000	317,445,200

アルフレッサ ホールディングス	87,600	2,377.500	208,269,000
横浜冷凍	24,300	1,109.000	26,948,700
ラサ商事	5,000	1,509.000	7,545,000
アルコニックス	12,000	1,320.000	15,840,000
神戸物産	67,500	3,904.000	263,520,000
あい ホールディングス	13,800	2,472.000	34,113,600
ダイワボウホールディングス	36,800	2,909.500	107,069,600
マクニカホールディングス	20,600	7,313.000	150,647,800
ラクト・ジャパン	3,800	1,951.000	7,413,800
グリムス	3,800	2,106.000	8,002,800
バイタルケーエスケー・ホールディングス	13,400	1,071.000	14,351,400
八洲電機	7,700	1,271.000	9,786,700
メディアスホールディングス	7,000	772.000	5,404,000
レスターホールディングス	8,000	2,683.000	21,464,000
ジオリーブグループ	3,000	1,245.000	3,735,000
大光	8,900	638.000	5,678,200
TOKAIホールディングス	42,300	941.000	39,804,300
三洋貿易	10,100	1,313.000	13,261,300
ビューティガレージ	3,000	2,520.000	7,560,000
ウイン・パートナーズ	6,800	1,192.000	8,105,600
シップヘルスケアホールディングス	31,500	2,087.500	65,756,250
コメダホールディングス	21,600	2,767.000	59,767,200
フルサト・マルカホールディングス	8,300	2,700.000	22,410,000
ヤマエグループホールディングス	5,000	3,465.000	17,325,000
小野建	8,700	1,687.000	14,676,900
南陽	2,500	2,058.000	5,145,000
佐鳥電機	4,600	1,964.000	9,034,400
伯東	5,000	5,470.000	27,350,000
コンドーテック	7,600	1,169.000	8,884,400
ナガイレーベン	11,000	2,272.000	24,992,000
三菱食品	8,300	4,860.000	40,338,000
松田産業	6,800	2,557.000	17,387,600
第一興商	33,800	2,235.000	75,543,000
メディパルホールディングス	88,100	2,340.000	206,154,000
S P K	4,400	1,829.000	8,047,600
萩原電気ホールディングス	4,500	4,940.000	22,230,000
アズワン	12,400	5,072.000	62,892,800
スズデン	3,800	2,283.000	8,675,400
尾家産業	2,500	1,890.000	4,725,000
シモジマ	6,700	1,262.000	8,455,400
ドウシシャ	9,000	2,110.000	18,990,000
高速	6,000	2,039.000	12,234,000
たけびし	3,700	1,888.000	6,985,600
リックス	2,000	3,280.000	6,560,000
丸文	8,300	1,508.000	12,516,400
ハピネット	7,900	2,577.000	20,358,300
日本ライフライン	25,700	1,164.000	29,914,800
タカショー	9,600	550.000	5,280,000



I D O M	26,800	922.000	24,709,600
進和	5,800	2,499.000	14,494,200
ダイترون	3,600	2,964.000	10,670,400
シークス	12,300	1,518.000	18,671,400
オーハシテクニカ	4,700	1,748.000	8,215,600
白銅	3,400	2,299.000	7,816,600
伊藤忠商事	584,000	5,738.000	3,350,992,000
丸紅	721,900	2,307.000	1,665,423,300
長瀬産業	39,500	2,323.500	91,778,250
蝶理	6,000	2,785.000	16,710,000
豊田通商	76,300	8,190.000	624,897,000
三共生興	14,600	742.000	10,833,200
兼松	33,700	2,054.000	69,219,800
三井物産	654,400	5,392.000	3,528,524,800
日本紙パルプ商事	4,600	4,995.000	22,977,000
カメイ	9,500	1,705.000	16,197,500
O U Gホールディングス	1,000	2,390.000	2,390,000
スターゼン	6,600	2,463.000	16,255,800
山善	22,400	1,200.000	26,880,000
椿本興業	2,500	6,040.000	15,100,000
住友商事	527,700	3,100.000	1,635,870,000
内田洋行	3,500	7,200.000	25,200,000
三菱商事	574,000	6,886.000	3,952,564,000
第一実業	9,300	1,916.000	17,818,800
キャノンマーケティングジャパン	20,200	3,731.000	75,366,200
西華産業	4,000	2,677.000	10,708,000
佐藤商事	6,300	1,524.000	9,601,200
菱洋エレクトロ	7,500	3,710.000	27,825,000
東京産業	8,900	869.000	7,734,100
ユアサ商事	7,500	4,430.000	33,225,000
神鋼商事	2,300	5,710.000	13,133,000
阪和興業	15,500	4,560.000	70,680,000
正栄食品工業	5,800	4,515.000	26,187,000
カナデン	6,700	1,473.000	9,869,100
R Y O D E N	7,100	2,606.000	18,502,600
岩谷産業	19,900	7,106.000	141,409,400
ナイス	2,600	1,619.000	4,209,400
極東貿易	5,900	1,888.000	11,139,200
アステナホールディングス	18,300	497.000	9,095,100
三愛オブリ	22,900	1,617.000	37,029,300
稲畑産業	16,900	3,165.000	53,488,500
G S Iクレオス	5,400	2,052.000	11,080,800
明和産業	12,500	659.000	8,237,500
ワキタ	16,100	1,485.000	23,908,500
東邦ホールディングス	22,800	3,230.000	73,644,000
サンゲツ	22,000	2,868.000	63,096,000
ミツウロコグループホールディングス	11,900	1,312.000	15,612,800
シナネンホールディングス	3,000	4,065.000	12,195,000

伊藤忠エネクス	21,100	1,528.000	32,240,800
サンリオ	24,800	6,069.000	150,511,200
サンワ テクノス	4,600	2,233.000	10,271,800
リョーサン	9,300	4,945.000	45,988,500
新光商事	12,300	1,208.000	14,858,400
トーホー	4,000	3,095.000	12,380,000
三信電気	3,900	2,296.000	8,954,400
東陽テクニカ	9,200	1,388.000	12,769,600
モスフードサービス	12,600	3,335.000	42,021,000
加賀電子	7,000	6,630.000	46,410,000
ソーダニッカ	8,000	1,034.000	8,272,000
立花エレクトック	6,400	2,905.000	18,592,000
PALTAC	13,800	4,755.000	65,619,000
三谷産業	18,600	334.000	6,212,400
太平洋興発	6,400	795.000	5,088,000
西本Wismettacホールディングス	2,300	6,190.000	14,237,000
KPPグループホールディングス	25,000	709.000	17,725,000
ヤマタネ	4,500	2,248.000	10,116,000
泉州電業	4,800	3,395.000	16,296,000
トラスコ中山	18,200	2,377.000	43,261,400
オートバックスセブン	30,100	1,545.500	46,519,550
モリト	7,300	1,295.000	9,453,500
加藤産業	10,600	4,680.000	49,608,000
イエローハット	15,000	1,778.000	26,670,000
JKホールディングス	7,200	967.000	6,962,400
日伝	6,500	2,651.000	17,231,500
杉本商事	5,000	2,246.000	11,230,000
因幡電機産業	21,900	3,280.000	71,832,000
東テク	3,000	4,745.000	14,235,000
ミスミグループ本社	131,500	2,400.000	315,600,000
タキヒヨー	2,900	1,018.000	2,952,200
スズケン	32,500	5,043.000	163,897,500
ジェコス	6,100	1,060.000	6,466,000
ローソン	19,100	7,321.000	139,831,100
サンエー	6,600	4,600.000	30,360,000
カワチ薬品	7,000	2,551.000	17,857,000
エービーシー・マート	37,800	2,440.500	92,250,900
ハードオフコーポレーション	3,800	1,530.000	5,814,000
アスクル	18,200	2,159.000	39,293,800
ゲオホールディングス	9,000	2,347.000	21,123,000
アダストリア	10,600	3,800.000	40,280,000
くら寿司	10,300	3,675.000	37,852,500
キャンドウ	4,200	2,619.000	10,999,800
バルグループホールディングス	17,000	2,336.000	39,712,000
エディオン	34,700	1,485.000	51,529,500
サーラコーポレーション	18,900	711.000	13,437,900
ハローズ	4,000	4,145.000	16,580,000
フジオフードグループ本社	10,600	1,444.000	15,306,400

あみやき亭	2,400	3,660.000	8,784,000
大黒天物産	2,700	6,160.000	16,632,000
ハニーズホールディングス	7,200	1,672.000	12,038,400
アルペン	7,300	1,950.000	14,235,000
クオールホールディングス	12,200	1,706.000	20,813,200
ジンスホールディングス	5,300	4,695.000	24,883,500
ビックカメラ	46,200	1,221.000	56,410,200
DCMホールディングス	50,000	1,279.000	63,950,000
MonotaRO	123,700	1,493.000	184,684,100
DDグループ	1,500	1,333.000	1,999,500
J.フロント リテイリング	104,200	1,354.500	141,138,900
ドトール・日レスホールディングス	15,400	2,195.000	33,803,000
マツキヨココカラ&カンパニー	158,700	2,553.500	405,240,450
ブロンコビリー	5,200	3,160.000	16,432,000
ZOZO	57,700	3,125.000	180,312,500
トレジャー・ファクトリー	4,200	1,263.000	5,304,600
物語コーポレーション	14,600	3,880.000	56,648,000
三越伊勢丹ホールディングス	147,000	1,671.000	245,637,000
ウエルシアホールディングス	45,400	2,584.000	117,313,600
クリエイトSDホールディングス	14,100	3,060.000	43,146,000
チムニー	3,500	1,387.000	4,854,500
シュッピン	7,200	1,238.000	8,913,600
オイシックス・ラ・大地	11,800	1,393.000	16,437,400
ネクステージ	20,000	2,289.000	45,780,000
ジョイフル本田	25,000	1,792.000	44,800,000
鳥貴族ホールディングス	3,700	2,838.000	10,500,600
ホットランド	7,100	1,972.000	14,001,200
すかいらくホールディングス	119,200	2,180.500	259,915,600
SFPホールディングス	4,600	2,233.000	10,271,800
綿半ホールディングス	7,100	1,370.000	9,727,000
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	29,300	1,011.000	29,622,300
BEENOS	3,800	1,495.000	5,681,000
あさひ	7,600	1,317.000	10,009,200
日本調剤	6,400	1,288.000	8,243,200
コスモス薬品	8,700	15,650.000	136,155,000
セブン&アイ・ホールディングス	300,400	5,495.000	1,650,698,000
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	59,700	1,045.000	62,386,500
ツルハホールディングス	18,300	12,440.000	227,652,000
サンマルクホールディングス	7,300	1,998.000	14,585,400
フェリシモ	4,000	913.000	3,652,000
トリドールホールディングス	21,600	4,151.000	89,661,600
TOKYO BASE	10,400	271.000	2,818,400
JMホールディングス	6,900	2,077.000	14,331,300
アレンザホールディングス	7,300	1,014.000	7,402,200
串カツ田中ホールディングス	3,800	1,625.000	6,175,000
クスリのアオキホールディングス	23,400	3,422.000	80,074,800

力の源ホールディングス	3,800	1,568.000	5,958,400
FOOD & LIFE COMPANIES	46,600	2,863.000	133,415,800
ノジマ	28,300	1,396.000	39,506,800
カップ・クリエイト	13,700	1,654.000	22,659,800
良品計画	95,400	2,336.500	222,902,100
アドヴァングループ	10,500	1,039.000	10,909,500
アルビス	3,100	2,581.000	8,001,100
G - 7ホールディングス	9,600	1,203.000	11,548,800
イオン北海道	15,200	892.000	13,558,400
コジマ	15,600	723.000	11,278,800
コーナン商事	11,800	3,700.000	43,660,000
エコス	3,700	2,227.000	8,239,900
ワタミ	10,300	1,040.000	10,712,000
パン・パシフィック・インターナショナル ホールディングス	176,200	3,204.000	564,544,800
西松屋チェーン	17,500	2,157.000	37,747,500
ゼンショーホールディングス	43,200	8,214.000	354,844,800
サイゼリヤ	13,000	5,740.000	74,620,000
V Tホールディングス	34,500	524.000	18,078,000
フジ・コーポレーション	3,800	1,600.000	6,080,000
ユナイテッドアローズ	9,400	1,959.000	18,414,600
ハイデイ日高	13,100	2,749.000	36,011,900
コロワイド	39,700	2,234.000	88,689,800
壱番屋	6,800	5,330.000	36,244,000
スギホールディングス	17,600	6,414.000	112,886,400
薬王堂ホールディングス	4,600	2,711.000	12,470,600
スクロール	13,200	925.000	12,210,000
ヨンドシーホールディングス	7,700	1,955.000	15,053,500
木曽路	12,800	2,491.000	31,884,800
S R Sホールディングス	15,700	1,037.000	16,280,900
リテールパートナーズ	12,900	1,778.000	22,936,200
上新電機	7,600	2,313.000	17,578,800
日本瓦斯	46,500	2,237.000	104,020,500
ロイヤルホールディングス	16,500	2,676.000	44,154,000
いなげや	8,600	1,501.000	12,908,600
チヨダ	9,500	843.000	8,008,500
ライフコーポレーション	7,700	3,405.000	26,218,500
リンガーハット	11,100	2,312.000	25,663,200
MrMaxHD	13,200	628.000	8,289,600
AOKIホールディングス	16,900	1,183.000	19,992,700
オークワ	14,700	830.000	12,201,000
コメリ	13,400	3,155.000	42,277,000
青山商事	18,900	1,581.000	29,880,900
しまむら	10,200	16,555.000	168,861,000
高島屋	64,100	1,992.500	127,719,250
松屋	15,300	859.000	13,142,700
エイチ・ツー・オー リテイリング	41,600	1,646.000	68,473,600

近鉄百貨店	4,800	2,643.000	12,686,400
丸井グループ	60,400	2,364.500	142,815,800
アクシアル リテイリング	5,900	3,895.000	22,980,500
イオン	295,700	3,061.000	905,137,700
イズミ	13,200	3,534.000	46,648,800
平和堂	14,800	2,322.000	34,365,600
フジ	13,200	1,875.000	24,750,000
ヤオコー	9,800	8,067.000	79,056,600
ゼビオホールディングス	12,200	944.000	11,516,800
ケースホールディングス	61,500	1,259.500	77,459,250
OLYMPICグループ	5,200	511.000	2,657,200
シルバーライフ	2,500	1,034.000	2,585,000
Genky DrugStores	3,700	5,100.000	18,870,000
ブックオフグループホールディングス	5,300	1,085.000	5,750,500
ギフトホールディングス	3,900	2,032.000	7,924,800
アインホールディングス	12,100	4,500.000	54,450,000
元気寿司	6,000	3,190.000	19,140,000
ヤマダホールディングス	289,700	428.500	124,136,450
アーケランズ	27,100	1,648.000	44,660,800
ニトリホールディングス	31,700	17,060.000	540,802,000
グルメ杵屋	8,300	1,060.000	8,798,000
ケーユーホールディングス	5,900	1,126.000	6,643,400
吉野家ホールディングス	34,000	3,270.000	111,180,000
松屋フーズホールディングス	4,100	5,000.000	20,500,000
サガミホールディングス	13,800	1,380.000	19,044,000
関西フードマーケット	7,700	1,415.000	10,895,500
王将フードサービス	5,800	8,010.000	46,458,000
ミニストップ	6,700	1,512.000	10,130,400
アークス	16,100	2,718.000	43,759,800
パローホールディングス	16,900	2,371.000	40,069,900
ベルク	4,300	6,370.000	27,391,000
大 庄	5,000	1,261.000	6,305,000
ファーストリテイリング	39,200	37,490.000	1,469,608,000
サンドラッグ	30,500	4,475.000	136,487,500
サックスパー ホールディングス	7,700	895.000	6,891,500
やまや	2,000	3,040.000	6,080,000
ベルーナ	21,200	626.000	13,271,200
いよぎんホールディングス	97,100	955.800	92,808,180
しずおかフィナンシャルグループ	180,800	1,196.000	216,236,800
ちゅうぎんフィナンシャルグループ	68,300	1,059.000	72,329,700
楽天銀行	27,700	2,558.000	70,856,600
京都フィナンシャルグループ	25,700	8,849.000	227,419,300
島根銀行	4,000	514.000	2,056,000
じもとホールディングス	7,000	557.000	3,899,000
めぶきフィナンシャルグループ	403,700	445.000	179,646,500
東京きらぼしフィナンシャルグループ	10,500	4,300.000	45,150,000
九州フィナンシャルグループ	142,300	832.800	118,507,440
ゆうちょ銀行	875,000	1,459.500	1,277,062,500

富山第一銀行	25,000	787.000	19,675,000
コンコルディア・フィナンシャルグループ	436,200	693.900	302,679,180
西日本フィナンシャルホールディングス	50,600	1,633.000	82,629,800
三十三フィナンシャルグループ	7,500	1,868.000	14,010,000
第四北越フィナンシャルグループ	12,600	3,940.000	49,644,000
ひろぎんホールディングス	105,700	927.000	97,983,900
おきなわフィナンシャルグループ	6,900	2,398.000	16,546,200
十六フィナンシャルグループ	10,500	3,830.000	40,215,000
北國フィナンシャルホールディングス	8,500	4,530.000	38,505,000
プロクレアホールディングス	10,100	1,897.000	19,159,700
あいちフィナンシャルグループ	11,400	2,345.000	26,733,000
あおぞら銀行	50,900	3,040.000	154,736,000
三菱UFJフィナンシャル・グループ	5,084,900	1,255.000	6,381,549,500
りそなホールディングス	970,600	768.500	745,906,100
三井住友トラスト・ホールディングス	145,800	5,559.000	810,502,200
三井住友フィナンシャルグループ	577,000	7,258.000	4,187,866,000
千葉銀行	226,400	1,106.500	250,511,600
群馬銀行	157,700	747.800	117,928,060
武蔵野銀行	10,200	2,856.000	29,131,200
千葉興業銀行	13,000	830.000	10,790,000
筑波銀行	32,000	267.000	8,544,000
七十七銀行	26,000	3,430.000	89,180,000
秋田銀行	4,800	1,977.000	9,489,600
山形銀行	9,000	1,059.000	9,531,000
岩手銀行	5,800	2,475.000	14,355,000
東邦銀行	60,000	291.000	17,460,000
東北銀行	3,000	1,163.000	3,489,000
ふくおかフィナンシャルグループ	64,800	3,433.000	222,458,400
スルガ銀行	72,600	751.000	54,522,600
八十二銀行	170,800	801.100	136,827,880
山梨中央銀行	7,900	1,794.000	14,172,600
大垣共立銀行	15,400	1,897.000	29,213,800
福井銀行	7,500	1,554.000	11,655,000
清水銀行	3,600	1,532.000	5,515,200
富山銀行	1,500	1,707.000	2,560,500
滋賀銀行	13,600	3,745.000	50,932,000
南都銀行	12,300	2,486.000	30,577,800
百五銀行	76,000	541.000	41,116,000
紀陽銀行	28,900	1,591.000	45,979,900
ほくほくフィナンシャルグループ	51,400	1,568.000	80,595,200
山陰合同銀行	50,500	958.000	48,379,000
鳥取銀行	2,500	1,325.000	3,312,500
百十四銀行	7,600	2,597.000	19,737,200
四国銀行	13,300	1,001.000	13,313,300
阿波銀行	11,500	2,495.000	28,692,500
大分銀行	5,100	2,642.000	13,474,200
宮崎銀行	5,200	2,646.000	13,759,200
佐賀銀行	5,100	1,875.000	9,562,500

琉球銀行	19,200	1,119.000	21,484,800
セブン銀行	292,900	300.300	87,957,870
みずほフィナンシャルグループ	1,105,300	2,512.000	2,776,513,600
高知銀行	2,500	964.000	2,410,000
山口フィナンシャルグループ	79,000	1,298.500	102,581,500
名古屋銀行	5,300	5,560.000	29,468,000
北洋銀行	123,000	365.000	44,895,000
大光銀行	2,500	1,308.000	3,270,000
愛媛銀行	11,600	1,008.000	11,692,800
トマト銀行	2,500	1,145.000	2,862,500
京葉銀行	37,400	701.000	26,217,400
栃木銀行	39,200	318.000	12,465,600
北日本銀行	2,600	2,116.000	5,501,600
東和銀行	15,200	622.000	9,454,400
大東銀行	3,000	766.000	2,298,000
トモニホールディングス	65,700	490.000	32,193,000
フィデアホールディングス	8,500	1,468.000	12,478,000
池田泉州ホールディングス	100,000	342.000	34,200,000
F P G	27,600	1,628.000	44,932,800
ジャパンインベストメントアドバイザー	6,800	1,579.000	10,737,200
マーキュリアホールディングス	5,700	807.000	4,599,900
S B Iホールディングス	117,400	3,207.000	376,501,800
ジャフコ グループ	27,500	1,703.000	46,832,500
大和証券グループ本社	597,200	955.400	570,564,880
野村ホールディングス	1,395,500	607.300	847,487,150
岡三証券グループ	72,600	714.000	51,836,400
丸三証券	28,000	849.000	23,772,000
東洋証券	29,400	299.000	8,790,600
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	87,000	553.000	48,111,000
水戸証券	23,800	436.000	10,376,800
いちよし証券	14,800	732.000	10,833,600
松井証券	47,900	742.000	35,541,800
マネックスグループ	83,500	661.000	55,193,500
極東証券	10,900	1,033.000	11,259,700
岩井コスモホールディングス	9,400	1,760.000	16,544,000
アイザワ証券グループ	12,200	1,198.000	14,615,600
スパークス・グループ	9,200	1,489.000	13,698,800
かんぼ生命保険	90,200	2,765.000	249,403,000
F P パートナー	1,300	5,000.000	6,500,000
S O M P Oホールディングス	132,300	6,757.000	893,951,100
アニコム ホールディングス	28,500	603.000	17,185,500
M S & A D インシュアランスグループホールディングス	176,700	5,533.000	977,681,100
第一生命ホールディングス	396,700	3,081.000	1,222,232,700
東京海上ホールディングス	802,400	3,648.000	2,927,155,200
T & Dホールディングス	226,700	2,186.500	495,679,550
アドバンスクリエイト	6,300	1,002.000	6,312,600
全国保証	21,400	4,997.000	106,935,800

あんしん保証	1,700	250.000	425,000
ジェイリース	2,400	1,867.000	4,480,800
日本モーゲージサービス	7,500	527.000	3,952,500
アルヒ	11,000	837.000	9,207,000
プレミアグループ	13,900	1,769.000	24,589,100
ネットプロテクションズホールディングス	17,200	243.000	4,179,600
クレディセゾン	51,400	2,490.500	128,011,700
芙蓉総合リース	7,400	12,000.000	88,800,000
みずほリース	11,900	4,960.000	59,024,000
東京センチュリー	15,100	5,892.000	88,969,200
日本証券金融	30,100	1,559.000	46,925,900
アイフル	135,400	379.000	51,316,600
リコーリース	7,600	4,640.000	35,264,000
イオンフィナンシャルサービス	46,500	1,267.000	58,915,500
アコム	148,500	348.500	51,752,250
ジャックス	8,600	5,370.000	46,182,000
オリエントコーポレーション	21,300	1,082.000	23,046,600
オリックス	501,500	2,698.500	1,353,297,750
三菱HCキャピタル	334,000	964.400	322,109,600
九州リースサービス	5,600	940.000	5,264,000
日本取引所グループ	214,800	3,019.000	648,481,200
イー・ギャランティ	13,700	1,942.000	26,605,400
アサックス	5,400	698.000	3,769,200
NECキャピタルソリューション	3,900	3,365.000	13,123,500
Robot Home	25,800	180.000	4,644,000
大東建託	29,700	16,300.000	484,110,000
いちご	100,700	351.000	35,345,700
日本駐車場開発	94,300	204.000	19,237,200
スター・マイカ・ホールディングス	11,000	607.000	6,677,000
SREホールディングス	4,200	2,774.000	11,650,800
ヒューリック	188,500	1,468.000	276,718,000
野村不動産ホールディングス	50,500	3,604.000	182,002,000
三重交通グループホールディングス	19,100	572.000	10,925,200
サムティ	10,100	2,342.000	23,654,200
ディア・ライフ	15,000	876.000	13,140,000
地主	7,100	2,306.000	16,372,600
プレサンスコーポレーション	13,900	1,504.000	20,905,600
JPMC	5,600	1,123.000	6,288,800
フージャースホールディングス	13,400	1,058.000	14,177,200
オープンハウスグループ	29,700	4,128.000	122,601,600
東急不動産ホールディングス	243,300	914.000	222,376,200
飯田グループホールディングス	77,000	2,210.000	170,170,000
シーアールイー	5,300	1,576.000	8,352,800
ケイアイスター不動産	4,200	3,490.000	14,658,000
グッドコムアセット	8,900	1,009.000	8,980,100
ジェイ・エス・ビー	4,400	2,561.000	11,268,400
ロードスターキャピタル	5,900	2,200.000	12,980,000
パーク24	53,500	1,802.500	96,433,750



パラカ	3,900	1,934.000	7,542,600
宮越ホールディングス	4,600	1,246.000	5,731,600
三井不動産	368,000	3,472.000	1,277,696,000
三菱地所	517,900	1,996.500	1,033,987,350
平和不動産	13,900	4,035.000	56,086,500
東京建物	72,700	2,101.500	152,779,050
京阪神ビルディング	15,700	1,418.000	22,262,600
住友不動産	123,700	4,174.000	516,323,800
テーオーシー	17,700	600.000	10,620,000
東京楽天地	1,800	4,300.000	7,740,000
レオパレス21	92,500	472.000	43,660,000
スターツコーポレーション	12,600	2,789.000	35,141,400
フジ住宅	12,700	715.000	9,080,500
空港施設	12,000	565.000	6,780,000
ゴールドクレスト	8,200	2,007.000	16,457,400
エスリード	4,200	3,180.000	13,356,000
日神グループホールディングス	15,200	495.000	7,524,000
日本エスコン	19,600	915.000	17,934,000
MIRARTHホールディングス	47,200	466.000	21,995,200
イオンモール	41,900	1,719.500	72,047,050
毎日コムネット	6,300	743.000	4,680,900
カチタス	22,400	2,150.000	48,160,000
トーセイ	14,600	1,801.000	26,294,600
穴吹興産	2,900	2,022.000	5,863,800
サンフロンティア不動産	15,500	1,560.000	24,180,000
FJネクストホールディングス	9,600	1,146.000	11,001,600
日本空港ビルデング	28,800	6,500.000	187,200,000
LIFULL	32,400	196.000	6,350,400
MIXI	19,100	2,417.000	46,164,700
ジェイエイシーリクルートメント	7,500	2,661.000	19,957,500
日本M&Aセンターホールディングス	136,300	685.200	93,392,760
メンバーズ	3,100	1,100.000	3,410,000
UTグループ	12,300	2,215.000	27,244,500
アイティメディア	3,500	972.000	3,402,000
E・Jホールディングス	5,400	1,605.000	8,667,000
オープンアップグループ	25,200	2,159.000	54,406,800
コシダカホールディングス	25,600	1,043.000	26,700,800
アルトナー	2,000	1,807.000	3,614,000
パソナグループ	10,200	2,345.000	23,919,000
リンクアンドモチベーション	26,100	586.000	15,294,600
エス・エム・エス	30,700	2,810.000	86,267,000
パーソルホールディングス	884,400	254.800	225,345,120
リニカル	6,300	530.000	3,339,000
学情	4,500	2,021.000	9,094,500
スタジオアリス	4,800	2,064.000	9,907,200
NJS	1,500	2,827.000	4,240,500
総合警備保障	150,300	856.800	128,777,040
カカコム	57,600	1,677.500	96,624,000

アイロムグループ	3,500	2,031.000	7,108,500
セントケア・ホールディング	5,600	936.000	5,241,600
ルネサンス	6,600	865.000	5,709,000
ディップ	13,500	3,170.000	42,795,000
デジタルホールディングス	5,500	1,265.000	6,957,500
新日本科学	7,700	1,647.000	12,681,900
キャリアデザインセンター	1,400	2,015.000	2,821,000
ベネフィット・ワン	31,000	1,515.000	46,965,000
エムスリー	169,000	2,445.500	413,289,500
アウトソーシング	54,400	1,200.000	65,280,000
ウェルネット	5,500	565.000	3,107,500
ワールドホールディングス	3,900	2,711.000	10,572,900
ディー・エヌ・エー	33,800	1,504.000	50,835,200
博報堂D Yホールディングス	107,800	1,115.500	120,250,900
タカミヤ	14,000	456.000	6,384,000
ファンコミュニケーションズ	15,000	417.000	6,255,000
ライク	3,800	1,364.000	5,183,200
エスプール	25,600	397.000	10,163,200
WDBホールディングス	4,500	2,313.000	10,408,500
アドウェイズ	12,200	551.000	6,722,200
パリュコマース	7,900	1,386.000	10,949,400
インフォマート	88,100	441.000	38,852,100
J Pホールディングス	27,100	391.000	10,596,100
プレステージ・インターナショナル	42,000	651.000	27,342,000
アミューズ	5,000	1,509.000	7,545,000
ドリームインキュベータ	2,800	3,230.000	9,044,000
クイック	5,800	2,257.000	13,090,600
電通グループ	83,200	3,985.000	331,552,000
ぴあ	3,100	3,315.000	10,276,500
イオンファンタジー	3,500	2,602.000	9,107,000
シーティーエス	10,600	667.000	7,070,200
H . U . グループホールディングス	24,800	2,569.000	63,711,200
アルプス技研	7,800	2,726.000	21,262,800
日本空調サービス	10,200	801.000	8,170,200
オリエンタルランド	449,000	5,025.000	2,256,225,000
ダスキン	21,000	3,258.000	68,418,000
明光ネットワークジャパン	13,800	717.000	9,894,600
ファルコホールディングス	4,300	2,117.000	9,103,100
ラウンドワン	78,000	590.000	46,020,000
リゾートトラスト	39,000	2,250.500	87,769,500
ビー・エム・エル	10,200	2,933.000	29,916,600
リソー教育	41,900	241.000	10,097,900
早稲田アカデミー	5,500	1,584.000	8,712,000
ユー・エス・エス	97,000	2,893.000	280,621,000
東京個別指導学院	12,400	480.000	5,952,000
サイバーエージェント	187,500	894.600	167,737,500
楽天グループ	725,600	585.700	424,983,920
クリーク・アンド・リバー社	5,100	2,093.000	10,674,300

SBIグローバルアセットマネジメント	15,800	557.000	8,800,600
テー・オー・ダブリュー	19,300	324.000	6,253,200
山田コンサルティンググループ	3,100	1,850.000	5,735,000
セントラルスポーツ	3,700	2,454.000	9,079,800
フルキャストホールディングス	8,000	1,917.000	15,336,000
エン・ジャパン	15,200	2,588.000	39,337,600
テクノプロ・ホールディングス	50,100	3,434.000	172,043,400
アイ・アールジャパンホールディングス	4,700	1,565.000	7,355,500
Keepers 技研	5,000	5,880.000	29,400,000
Gunosy	8,100	696.000	5,637,600
イー・ガーディアン	3,700	1,539.000	5,694,300
ジャパンマテリアル	26,000	2,597.000	67,522,000
ベクトル	11,700	1,093.000	12,788,100
チャーム・ケア・コーポレーション	7,400	1,199.000	8,872,600
キャリアリンク	3,200	2,188.000	7,001,600
IBJ	7,100	739.000	5,246,900
アサンテ	5,200	1,616.000	8,403,200
パリュールHR	8,000	1,498.000	11,984,000
M&Aキャピタルパートナーズ	6,900	2,267.000	15,642,300
ライドオンエクスプレスホールディングス	4,200	1,017.000	4,271,400
ERIホールディングス	1,900	1,723.000	3,273,700
アビスト	500	3,040.000	1,520,000
シグマクス・ホールディングス	11,300	1,326.000	14,983,800
ウィルグループ	7,000	1,119.000	7,833,000
メドピア	7,700	768.000	5,913,600
リクルートホールディングス	628,000	5,505.000	3,457,140,000
エラン	11,500	1,019.000	11,718,500
日本郵政	999,800	1,304.500	1,304,239,100
ベルシステム24ホールディングス	11,600	1,664.000	19,302,400
鎌倉新書	7,400	583.000	4,314,200
エアトリ	6,500	1,571.000	10,211,500
アトラエ	5,900	717.000	4,230,300
ストライク	3,800	3,880.000	14,744,000
ソラスト	23,700	587.000	13,911,900
セラク	2,900	1,339.000	3,883,100
インソース	18,500	955.000	17,667,500
ベイカレント・コンサルティング	62,200	4,976.000	309,507,200
アイモバイル	14,100	459.000	6,471,900
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	27,300	2,350.000	64,155,000
グリーンズ	2,400	1,941.000	4,658,400
ウェルビー	5,400	745.000	4,023,000
エル・ティー・エス	1,300	3,885.000	5,050,500
ミダックホールディングス	5,300	1,752.000	9,285,600
キュービーネットホールディングス	4,700	1,521.000	7,148,700
RPAホールディングス	13,400	302.000	4,046,800
マネジメントソリューションズ	3,800	2,919.000	11,092,200
フロンティア・マネジメント	2,300	1,565.000	3,599,500

アンビスホールディングス	8,600	2,875.000	24,725,000
カーブスホールディングス	23,200	667.000	15,474,400
フォーラムエンジニアリング	10,200	795.000	8,109,000
FAST FITNESS JAPAN	3,400	1,115.000	3,791,000
ダイレクトマーケティングミックス	10,900	461.000	5,024,900
LITALICO	6,700	2,141.000	14,344,700
リログループ	45,700	1,553.000	70,972,100
東祥	6,900	816.000	5,630,400
ID&E ホールディングス	5,100	3,275.000	16,702,500
ビーウィズ	2,400	2,271.000	5,450,400
TREホールディングス	17,900	1,122.000	20,083,800
人・夢・技術グループ	3,600	1,854.000	6,674,400
NISSOホールディングス	6,800	786.000	5,344,800
大栄環境	15,500	2,321.000	35,975,500
日本管財ホールディングス	8,400	2,488.000	20,899,200
M&A総研ホールディングス	4,000	3,800.000	15,200,000
エイチ・アイ・エス	24,700	1,722.000	42,533,400
ラックランド	4,100	2,735.000	11,213,500
共立メンテナンス	14,300	5,739.000	82,067,700
イチネンホールディングス	9,100	1,543.000	14,041,300
建設技術研究所	4,400	4,855.000	21,362,000
スペース	7,100	907.000	6,439,700
燦ホールディングス	7,600	1,104.000	8,390,400
スバル興業	500	13,230.000	6,615,000
東京テアトル	5,000	1,092.000	5,460,000
タナベコンサルティンググループ	1,500	1,040.000	1,560,000
ナガワ	2,900	6,690.000	19,401,000
東京都競馬	7,200	4,410.000	31,752,000
カナモト	14,400	2,580.000	37,152,000
ニシオホールディングス	7,600	3,640.000	27,664,000
トランス・コスモス	10,400	3,100.000	32,240,000
乃村工藝社	36,600	840.000	30,744,000
藤田観光	3,800	3,970.000	15,086,000
KNT-CTホールディングス	2,000	1,245.000	2,490,000
トーカイ	7,500	1,915.000	14,362,500
セコム	86,200	10,295.000	887,429,000
セントラル警備保障	4,700	2,454.000	11,533,800
丹青社	17,000	890.000	15,130,000
メイテックグループホールディングス	32,500	2,867.500	93,193,750
応用地質	7,800	2,091.000	16,309,800
船井総研ホールディングス	17,600	2,521.000	44,369,600
いであ	2,500	1,756.000	4,390,000
学究社	4,200	1,934.000	8,122,800
イオンディライト	9,200	3,515.000	32,338,000
ダイセキ	17,300	3,920.000	67,816,000
ステップ	3,200	1,875.000	6,000,000
合 計	123,739,300		277,901,462,330

## (b) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

## デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

## 2.2.5 マザーファンド

## (1) 貸借対照表

(単位：円)

	(2022年11月30日現在)	(2023年11月30日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	368,069,569	62,053,624
コール・ローン	2,271,021,676	3,726,162,018
株式	125,784,079,960	151,843,908,800
派生商品評価勘定	51,424,400	14,830,900
未収配当金	787,322,520	819,046,650
前払金	-	22,601,000
差入委託証拠金	39,102,000	246,222,556
流動資産合計	129,301,020,125	156,734,825,548
資産合計	129,301,020,125	156,734,825,548
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	2,759,700	4,095,900
前受金	49,720,000	-
未払解約金	2,826,312	4,741,623
その他未払費用	8,270	6,644
流動負債合計	55,314,282	8,844,167
負債合計	55,314,282	8,844,167
純資産の部		
元本等		
元本	34,776,887,242	34,431,110,224
剰余金		
剰余金又は欠損金( )	94,468,818,601	122,294,871,157
元本等合計	129,245,705,843	156,725,981,381
純資産合計	129,245,705,843	156,725,981,381
負債純資産合計	129,301,020,125	156,734,825,548

## (2) 注記表

## (重要な会計方針の注記)

項目	自 2022年12月1日 至 2023年11月30日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。 (1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。

	<p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券</p> <p>金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券</p> <p>直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場によっております。</p>

（重要な会計上の見積りに関する注記）

会計上の見積りについて、翌計算期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクがある項目を識別していないため、注記を省略しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	（2022年11月30日現在）	（2023年11月30日現在）
1. 担保資産	<p>デリバティブ取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として担保に供している資産は次の通りであります。</p> <p>株式 808,100,000円</p>	
2. 当計算期間の末日における受益権の総数	34,776,887,242口	34,431,110,224口
3. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 3.7164円 （1万口当たりの純資産額37,164円）	1口当たり純資産額 4.5519円 （1万口当たりの純資産額45,519円）

（金融商品に関する注記）

・金融商品の状況に関する事項

項目	自 2022年12月1日 至 2023年11月30日
1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。</p>
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券</p> <p>当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、株式を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引</p> <p>当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。</p> <p>当計算期間については、先物取引を行っております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p>

	<p>(2) 金融商品に係るリスク</p> <p>有価証券およびデリバティブ取引等</p> <p>当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。なお、投資信託協会の流動性リスク管理規制に抵触する場合には、流動性リスクを管理する会議で審議の上、流動性リスクの管理責任者が対処方針を決定します。その後、決定した対処方針やその実施等について、リスク管理会議に報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>

### ・金融商品の時価等に関する事項

項目	(2023年11月30日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（株式）</p> <p>「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引）</p> <p>デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。

## （デリバティブ取引に関する注記）

（2022年11月30日現在）

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			う ち 1 年 超		
市場取引	株価指数先物取引 買建				
	NK225 先物 0412月	3,400,255,300	-	3,448,920,000	48,664,700
	小計	3,400,255,300	-	3,448,920,000	48,664,700
合 計		3,400,255,300	-	3,448,920,000	48,664,700

（2023年11月30日現在）

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			う ち 1 年 超		
市場取引	株価指数先物取引 買建				
	NK225 先物 0512月	4,846,765,000	-	4,857,500,000	10,735,000
	小計	4,846,765,000	-	4,857,500,000	10,735,000
合 計		4,846,765,000	-	4,857,500,000	10,735,000

（注）1．時価の算定方法

株価指数先物取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

1)原則として計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しております。

このような時価が発表されていない場合には、計算期間末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

2)株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

2．ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

## （関連当事者との取引に関する注記）

自 2022年12月1日 至 2023年11月30日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

## （その他の注記）

（2022年11月30日現在）	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	28,339,379,860円
同期中における追加設定元本額	16,323,741,365円
同期中における一部解約元本額	9,886,233,983円



## 2022年11月30日現在の元本の内訳

三井住友・225オープン	31,600,774,848円
三井住友・DC年金日本株式225ファンド	2,357,385,245円
S M B C・DCインデックスファンド(日経225)	658,797,360円
三井住友D S・日経225インデックス・ファンド	73,400,444円
日本株式225ファンドV A < 適格機関投資家専用 >	86,529,345円
合 計	34,776,887,242円

## (2023年11月30日現在)

## 開示対象ファンドの

期首における当該親投資信託の元本額	34,776,887,242円
同期中における追加設定元本額	13,300,723,804円
同期中における一部解約元本額	13,646,500,822円

## 2023年11月30日現在の元本の内訳

三井住友・225オープン	30,691,671,805円
三井住友・DC年金日本株式225ファンド	2,252,121,215円
S M B C・DCインデックスファンド(日経225)	1,305,613,973円
三井住友D S・日経225インデックス・ファンド	113,484,036円
日本株式225ファンドV A < 適格機関投資家専用 >	68,219,195円
合 計	34,431,110,224円

## (3) 附属明細表

## 有価証券明細表

## (a) 株式

(単位：円)

銘柄	株数	評価額		備考
		単価	金額	
ニッセイ	151,000	737.400	111,347,400	
I N P E X	60,400	2,090.000	126,236,000	
コムシスホールディングス	151,000	3,207.000	484,257,000	
大成建設	30,200	5,031.000	151,936,200	
大林組	151,000	1,247.500	188,372,500	
清水建設	151,000	971.600	146,711,600	
長谷工コーポレーション	30,200	1,818.500	54,918,700	
鹿島建設	75,500	2,336.500	176,405,750	
大和ハウス工業	151,000	4,199.000	634,049,000	
積水ハウス	151,000	3,029.000	457,379,000	
日揮ホールディングス	151,000	1,661.500	250,886,500	
日清製粉グループ本社	151,000	2,048.500	309,323,500	
明治ホールディングス	60,400	3,423.000	206,749,200	
日本ハム	75,500	4,394.000	331,747,000	
サッポロホールディングス	30,200	5,766.000	174,133,200	
アサヒグループホールディングス	151,000	5,455.000	823,705,000	
麒麟ホールディングス	151,000	2,087.000	315,137,000	
宝ホールディングス	151,000	1,215.000	183,465,000	

キッコーマン	151,000	9,065.000	1,368,815,000
味の素	151,000	5,526.000	834,426,000
ニチレイ	75,500	3,224.000	243,412,000
日本たばこ産業	151,000	3,801.000	573,951,000
帝人	30,200	1,345.500	40,634,100
東レ	151,000	767.100	115,832,100
王子ホールディングス	151,000	549.200	82,929,200
日本製紙	15,100	1,337.000	20,188,700
クラレ	151,000	1,504.500	227,179,500
旭化成	151,000	1,026.500	155,001,500
レゾナック・ホールディングス	15,100	2,760.000	41,676,000
住友化学	151,000	377.500	57,002,500
日産化学	151,000	5,393.000	814,343,000
東ソー	75,500	1,967.000	148,508,500
トクヤマ	30,200	2,401.000	72,510,200
デンカ	30,200	2,645.000	79,879,000
信越化学工業	755,000	5,212.000	3,935,060,000
三井化学	30,200	4,328.000	130,705,600
三菱ケミカルグループ	75,500	968.500	73,121,750
U B E	15,100	2,323.500	35,084,850
花王	151,000	5,696.000	860,096,000
D I C	15,100	2,433.500	36,745,850
富士フイルムホールディングス	151,000	8,660.000	1,307,660,000
資生堂	151,000	3,966.000	598,866,000
日東電工	151,000	10,515.000	1,587,765,000
協和キリン	151,000	2,437.000	367,987,000
武田薬品工業	151,000	4,165.000	628,915,000
アステラス製薬	755,000	1,797.500	1,357,112,500
住友ファーマ	151,000	468.000	70,668,000
塩野義製薬	151,000	6,978.000	1,053,678,000
中外製薬	453,000	5,218.000	2,363,754,000
エーザイ	151,000	7,672.000	1,158,472,000
第一三共	453,000	4,000.000	1,812,000,000
大塚ホールディングス	151,000	5,689.000	859,039,000
出光興産	60,400	4,056.000	244,982,400
E N E O Sホールディングス	151,000	584.400	88,244,400
横浜ゴム	75,500	3,289.000	248,319,500
ブリヂストン	151,000	6,098.000	920,798,000
A G C	30,200	5,370.000	162,174,000
日本電気硝子	45,300	3,120.000	141,336,000
住友大阪セメント	15,100	3,608.000	54,480,800
太平洋セメント	15,100	2,777.500	41,940,250
東海カーボン	151,000	1,094.000	165,194,000
T O T O	75,500	3,797.000	286,673,500
日本碍子	151,000	1,804.000	272,404,000
日本製鉄	15,100	3,457.000	52,200,700
神戸製鋼所	15,100	1,731.500	26,145,650
J F Eホールディングス	15,100	2,180.000	32,918,000

大平洋金属	15,100	1,234.000	18,633,400
三井金属鉱業	15,100	4,540.000	68,554,000
三菱マテリアル	15,100	2,434.000	36,753,400
住友金属鉱山	75,500	4,292.000	324,046,000
DOWAホールディングス	30,200	5,256.000	158,731,200
古河電気工業	15,100	2,378.500	35,915,350
住友電気工業	151,000	1,834.000	276,934,000
フジクラ	151,000	1,138.500	171,913,500
SUMCO	15,100	2,216.500	33,469,150
日本製鋼所	30,200	2,553.500	77,115,700
オークマ	30,200	6,194.000	187,058,800
アマダ	151,000	1,482.500	223,857,500
SMC	15,100	74,450.000	1,124,195,000
小松製作所	151,000	3,772.000	569,572,000
住友重機械工業	30,200	3,529.000	106,575,800
日立建機	151,000	3,835.000	579,085,000
クボタ	151,000	2,119.000	319,969,000
荏原製作所	30,200	8,371.000	252,804,200
ダイキン工業	151,000	22,155.000	3,345,405,000
日本精工	151,000	775.100	117,040,100
NTN	151,000	276.900	41,811,900
ジェイテクト	151,000	1,355.500	204,680,500
日立造船	30,200	901.000	27,210,200
三菱重工業	15,100	8,268.000	124,846,800
IHI	15,100	2,856.000	43,125,600
コニカミノルタ	151,000	467.900	70,652,900
ミネベアミツミ	151,000	2,813.000	424,763,000
日立製作所	30,200	10,285.000	310,607,000
三菱電機	151,000	2,009.000	303,359,000
富士電機	30,200	6,201.000	187,270,200
安川電機	151,000	5,673.000	856,623,000
ニデック	120,800	5,604.000	676,963,200
オムロン	151,000	6,199.000	936,049,000
ジーエス・ユアサ コーポレーション	30,200	2,173.500	65,639,700
日本電気	15,100	8,240.000	124,424,000
富士通	15,100	21,120.000	318,912,000
ルネサスエレクトロニクス	151,000	2,603.500	393,128,500
セイコーエプソン	302,000	2,198.000	663,796,000
パナソニック ホールディングス	151,000	1,530.000	231,030,000
シャープ	151,000	925.600	139,765,600
ソニーグループ	151,000	12,820.000	1,935,820,000
TDK	453,000	6,870.000	3,112,110,000
アルプスアルパイン	151,000	1,295.500	195,620,500
横河電機	151,000	2,801.000	422,951,000
アドバンテスト	1,208,000	4,681.000	5,654,648,000
キーエンス	15,100	63,350.000	956,585,000
レーザーテック	60,400	33,040.000	1,995,616,000
カシオ計算機	151,000	1,249.000	188,599,000

ファナック	755,000	4,114.000	3,106,070,000
京セラ	302,000	8,190.000	2,473,380,000
太陽誘電	151,000	3,834.000	578,934,000
村田製作所	362,400	2,883.500	1,044,980,400
S C R E E Nホールディングス	60,400	10,770.000	650,508,000
キヤノン	226,500	3,807.000	862,285,500
リコー	151,000	1,207.000	182,257,000
東京エレクトロン	453,000	24,025.000	10,883,325,000
デンソー	604,000	2,314.000	1,397,656,000
川崎重工業	15,100	3,363.000	50,781,300
日産自動車	151,000	582.900	88,017,900
いすゞ自動車	75,500	1,955.500	147,640,250
トヨタ自動車	755,000	2,794.500	2,109,847,500
日野自動車	151,000	477.400	72,087,400
三菱自動車工業	15,100	481.400	7,269,140
マツダ	30,200	1,578.500	47,670,700
本田技研工業	906,000	1,509.000	1,367,154,000
スズキ	151,000	6,021.000	909,171,000
S U B A R U	151,000	2,621.000	395,771,000
ヤマハ発動機	151,000	3,777.000	570,327,000
テルモ	604,000	4,718.000	2,849,672,000
ニコン	151,000	1,424.500	215,099,500
オリンパス	604,000	2,166.000	1,308,264,000
H O Y A	75,500	16,665.000	1,258,207,500
シチズン時計	151,000	867.000	130,917,000
バンダイナムコホールディングス	453,000	2,943.000	1,333,179,000
T O P P A Nホールディングス	75,500	3,464.000	261,532,000
大日本印刷	75,500	4,153.000	313,551,500
ヤマハ	151,000	3,461.000	522,611,000
任天堂	151,000	6,912.000	1,043,712,000
東京電力ホールディングス	15,100	630.900	9,526,590
中部電力	15,100	1,827.000	27,587,700
関西電力	15,100	1,971.000	29,762,100
東京瓦斯	30,200	3,427.000	103,495,400
大阪瓦斯	30,200	2,880.000	86,976,000
東武鉄道	30,200	3,655.000	110,381,000
東急	75,500	1,735.500	131,030,250
小田急電鉄	75,500	2,079.500	157,002,250
京王電鉄	30,200	4,263.000	128,742,600
京成電鉄	75,500	5,960.000	449,980,000
東日本旅客鉄道	15,100	7,995.000	120,724,500
西日本旅客鉄道	15,100	5,847.000	88,289,700
東海旅客鉄道	75,500	3,550.000	268,025,000
ヤマトホールディングス	151,000	2,628.500	396,903,500
N I P P O N E X P R E S Sホールディングス	15,100	8,071.000	121,872,100
日本郵船	45,300	3,974.000	180,022,200
商船三井	45,300	4,061.000	183,963,300

川崎汽船	45,300	5,189.000	235,061,700
日本航空	151,000	2,811.000	424,461,000
A N Aホールディングス	15,100	3,052.000	46,085,200
三菱倉庫	75,500	4,431.000	334,540,500
ネクソン	302,000	3,198.000	965,796,000
メルカリ	151,000	2,829.500	427,254,500
L I N Eヤフー	60,400	430.600	26,008,240
トレンドマイクロ	151,000	7,514.000	1,134,614,000
日本電信電話	1,510,000	173.100	261,381,000
K D D I	906,000	4,625.000	4,190,250,000
ソフトバンク	151,000	1,798.500	271,573,500
東宝	15,100	5,131.000	77,478,100
N T Tデータグループ	755,000	1,797.000	1,356,735,000
コナミグループ	151,000	7,315.000	1,104,565,000
ソフトバンクグループ	906,000	6,020.000	5,454,120,000
双日	15,100	3,293.000	49,724,300
伊藤忠商事	151,000	5,738.000	866,438,000
丸紅	151,000	2,307.000	348,357,000
豊田通商	151,000	8,190.000	1,236,690,000
三井物産	151,000	5,392.000	814,192,000
住友商事	151,000	3,100.000	468,100,000
三菱商事	151,000	6,886.000	1,039,786,000
J . フロント リテイリング	75,500	1,354.500	102,264,750
三越伊勢丹ホールディングス	151,000	1,671.000	252,321,000
セブン&アイ・ホールディングス	151,000	5,495.000	829,745,000
高島屋	75,500	1,992.500	150,433,750
丸井グループ	151,000	2,364.500	357,039,500
イオン	151,000	3,061.000	462,211,000
ニトリホールディングス	45,300	17,060.000	772,818,000
ファーストリテイリング	453,000	37,490.000	16,982,970,000
しずおかフィナンシャルグループ	151,000	1,196.000	180,596,000
コンコルディア・フィナンシャルグループ	151,000	693.900	104,778,900
あおぞら銀行	15,100	3,040.000	45,904,000
三菱U F Jフィナンシャル・グループ	151,000	1,255.000	189,505,000
りそなホールディングス	15,100	768.500	11,604,350
三井住友トラスト・ホールディングス	15,100	5,559.000	83,940,900
三井住友フィナンシャルグループ	15,100	7,258.000	109,595,800
千葉銀行	151,000	1,106.500	167,081,500
ふくおかフィナンシャルグループ	30,200	3,433.000	103,676,600
みずほフィナンシャルグループ	15,100	2,512.000	37,931,200
大和証券グループ本社	151,000	955.400	144,265,400
野村ホールディングス	151,000	607.300	91,702,300
S O M P Oホールディングス	30,200	6,757.000	204,061,400
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	45,300	5,533.000	250,644,900
第一生命ホールディングス	15,100	3,081.000	46,523,100
東京海上ホールディングス	226,500	3,648.000	826,272,000
T & Dホールディングス	30,200	2,186.500	66,032,300

クレディセゾン	151,000	2,490.500	376,065,500
オリックス	151,000	2,698.500	407,473,500
日本取引所グループ	151,000	3,019.000	455,869,000
東急不動産ホールディングス	151,000	914.000	138,014,000
三井不動産	151,000	3,472.000	524,272,000
三菱地所	151,000	1,996.500	301,471,500
東京建物	75,500	2,101.500	158,663,250
住友不動産	151,000	4,174.000	630,274,000
エムスリー	362,400	2,445.500	886,249,200
ディー・エヌ・エー	45,300	1,504.000	68,131,200
電通グループ	151,000	3,985.000	601,735,000
オリエンタルランド	151,000	5,025.000	758,775,000
サイバーエージェント	120,800	894.600	108,067,680
楽天グループ	151,000	585.700	88,440,700
リクルートホールディングス	453,000	5,505.000	2,493,765,000
日本郵政	151,000	1,304.500	196,979,500
セコム	151,000	10,295.000	1,554,545,000
合 計	35,273,600		151,843,908,800

## (b) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

## デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

## 外国株式インデックス・マザーファンド

## ( 1 ) 貸借対照表

( 単位：円 )

	( 2022年11月30日現在 )	( 2023年11月30日現在 )
資産の部		
流動資産		
預金	12,344,954,615	7,069,482,837
金銭信託	306,406,160	39,692,180
コール・ローン	1,890,553,005	2,383,414,261
株式	411,677,365,126	582,354,704,334
投資証券	10,072,502,218	12,320,377,867
派生商品評価勘定	487,638,687	526,000,376
未収入金	1,756,879	3,409,345
未収配当金	582,453,884	803,404,260
差入委託証拠金	5,033,061,489	3,327,880,510
流動資産合計	442,396,692,063	608,828,365,970
資産合計	442,396,692,063	608,828,365,970
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	34,123,826	7,844,047
未払金	-	321,138,161
未払解約金	161,000,409	1,118,815,080
その他未払費用	6,376	1,630

流動負債合計	195,130,611	1,447,798,918
負債合計	195,130,611	1,447,798,918
純資産の部		
元本等		
元本	72,186,242,919	81,052,032,606
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	370,015,318,533	526,328,534,446
元本等合計	442,201,561,452	607,380,567,052
純資産合計	442,201,561,452	607,380,567,052
負債純資産合計	442,396,692,063	608,828,365,970

## (2) 注記表

## (重要な会計方針の注記)

項目	自 2022年12月1日 至 2023年11月30日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式、投資証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1) 先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場によっております。</p> <p>(2) 為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>
3. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	<p>外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。</p>

## (重要な会計上の見積りに関する注記)

会計上の見積りについて、翌計算期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクがある項目を識別していないため、注記を省略しております。

## (貸借対照表に関する注記)

項目	(2022年11月30日現在)	(2023年11月30日現在)
----	-----------------	-----------------

1. 当計算期間の末日における受益権の総数	72,186,242,919口	81,052,032,606口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 6.1258円 (1万口当たりの純資産額61,258円)	1口当たり純資産額 7.4937円 (1万口当たりの純資産額74,937円)

## (金融商品に関する注記)

## . 金融商品の状況に関する事項

項目	自 2022年12月1日 至 2023年11月30日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、株式、投資証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 当計算期間については、先物取引、為替予約取引を行っております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>



<p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p>	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。なお、投資信託協会の流動性リスク管理規制に抵触する場合には、流動性リスクを管理する会議で審議の上、流動性リスクの管理責任者が対処方針を決定します。その後、決定した対処方針やその実施等について、リスク管理会議に報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>
--------------------------	--

・金融商品の時価等に関する事項

項目	(2023年11月30日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（株式、投資証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。

(デリバティブ取引に関する注記)

(2022年11月30日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			う ち 1 年 超		
市場取引	株価指数先物取引 買建				
	S&P 500 EMINI FUT DEC22	15,697,974,160	-	15,983,395,407	285,421,247
	SPI 200 FUTURES DEC22	734,736,737	-	757,862,325	23,125,588
	FTSE 100 IDX FUT DEC22	934,911,597	-	963,434,172	28,522,575
	EURO STOXX 50 DEC22	2,969,277,474	-	3,089,695,148	120,417,674
	小計	20,336,899,968	-	20,794,387,052	457,487,084
	合 計	20,336,899,968	-	20,794,387,052	457,487,084

(単位:円)

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			う ち 1 年 超		
市場取引以 外の取引	為替予約取引 買建				
	アメリカ・ドル	2,099,249,487	-	2,098,826,011	423,476
	カナダ・ドル	106,801,796	-	105,519,193	1,282,603
	オーストラリア・ド ル	34,202,370	-	33,957,955	244,415
	イギリス・ポンド	87,718,707	-	87,086,511	632,196
	スイス・フラン	91,286,164	-	90,606,304	679,860
	デンマーク・クロー ネ	24,504,100	-	24,483,812	20,288
	スウェーデン・ク ローナ	30,621,024	-	30,535,733	85,291
	ユーロ	171,328,650	-	170,699,141	629,509
	小計	2,645,712,298	-	2,641,714,660	3,997,638
	売建				
	オーストラリア・ド ル	72,454,928	-	72,740,539	285,611
	イギリス・ポンド	89,625,998	-	89,588,968	37,030
	ユーロ	305,223,048	-	304,949,052	273,996
	小計	467,303,974	-	467,278,559	25,415
	合 計	3,113,016,272	-	3,108,993,219	3,972,223

(2023年11月30日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位:円)

		契 約 額 等		
--	--	---------	--	--

区 分	種 類		うち	時 価	評価損益
			1 年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建				
	S&P 500 EMINI FUT DEC23	9,089,051,010	-	9,521,510,345	432,459,335
	SPI 200 FUTURES DEC23	374,437,008	-	378,076,765	3,639,757
	FTSE 100 IDX FUT DEC23	532,259,516	-	528,482,545	3,776,971
	EURO STOXX 50 DEC23	1,720,658,091	-	1,803,493,340	82,835,249
	小計	11,716,405,625	-	12,231,562,995	515,157,370
	合 計	11,716,405,625	-	12,231,562,995	515,157,370

## (注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

- 1) 原則として計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しております。

このような時価が発表されていない場合には、計算期間末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

- 2) 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

## 2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(単位：円)

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評価損益
			うち 1 年超		
市場取引以 外の取引	為替予約取引 買建				
	アメリカ・ドル	880,492,733	-	881,407,875	915,142
	イギリス・ポンド	48,914,666	-	48,914,587	79
	ユーロ	82,964,842	-	82,966,487	1,645
	小計	1,012,372,241	-	1,013,288,949	916,708
	売建				
	アメリカ・ドル	292,266,242	-	290,264,629	2,001,613
イギリス・ポンド	51,266,961	-	51,186,323	80,638	
小計	343,533,203	-	341,450,952	2,082,251	
合 計		1,355,905,444	-	1,354,739,901	2,998,959

## (注) 1. 時価の算定方法

為替予約取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

- 1) 計算期間末日に対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。

計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

- ・計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、発表されている対顧客先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの対顧客先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。
- ・計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い受渡日として、発表されている対顧客先物相場の仲値を用いております。

2)計算期間末日において対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については、計算期間末日の対顧客相場の仲値で評価しております。

3)上記の算定方法にて、適正な時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認められた価額で評価しております。

2.ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

自 2022年12月1日 至 2023年11月30日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

(その他の注記)

(2022年11月30日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	60,650,874,522円
同期中における追加設定元本額	22,050,143,482円
同期中における一部解約元本額	10,514,775,085円
2022年11月30日現在の元本の内訳	
三井住友・DC外国株式インデックスファンドS	36,369,253,618円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	284,736,068円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	1,090,013,037円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	785,999,194円
S M A M・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	33,400,233円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020(4資産タイプ)	1,017,107円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025(4資産タイプ)	5,342,658円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2030(4資産タイプ)	16,884,192円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2035(4資産タイプ)	49,323,143円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040(4資産タイプ)	54,445,231円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045(4資産タイプ)	105,113,958円
外国株式指数ファンド	936,693,371円
三井住友・DCつみたてN I S A・全海外株インデックスファンド	17,542,779,547円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	90,349,697円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	117,821,294円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	75,689,448円
イオン・バランス戦略ファンド	20,982,589円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2050	21,006,539円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	130,889,105円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	118,201,443円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	437,684,453円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	238,781,337円

三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	274,840,665円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	54,612,889円
三井住友DS・外国株式インデックス年金ファンド	1,637,991,448円
三井住友DS・年金バランス30(債券重点型)	10,892,390円
三井住友DS・年金バランス50(標準型)	47,697,547円
三井住友DS・年金バランス70(株式重点型)	42,074,552円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	2,714,893円
SMB C・DCインデックスファンド(MSCIコクサイ)	397,450,005円
日興FWS・先進国株インデックス(為替ヘッジあり)	250,037,372円
日興FWS・先進国株インデックス(為替ヘッジなし)	1,466,576,467円
三井住友DS・先進国株式インデックス・ファンド	50,536,075円
SMAM・外国株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	449,296,410円
バランスファンドVA(安定運用型)<適格機関投資家限定>	3,279,377円
SMAM・バランスファンドVA安定成長型<適格機関投資家限定>	20,004,315円
SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	536,704,870円
SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	702,957,041円
SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	3,074,190,088円
SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	9,972,101円
SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	49,989,232円
SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	423,311,736円
SMAM・バランスファンドVL国際分散型<適格機関投資家限定>	36,093,954円
SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	90,939,599円
SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	427,001,205円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	293,567,068円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	687,726,675円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	200,225円
三井住友・外国株式インデックスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	194,459,687円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	59,953,329円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	7,255,976円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	6,951,628円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	3,833,026円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	17,103,227円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	51,782,752円
SMAM・グローバルバランスファンド(標準型)VA<適格機関投資家限定>	110,286,434円
SMAM・グローバルバランスファンド(債券重視型)VA<適格機関投資家限定>	46,890,632円
SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	281,352,925円
SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定>	80,381,144円
SMAM・外国株式インデックスファンドSA<適格機関投資家限定>	1,662,845,853円
SMAM・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	17,217,947円
SMAM・マルチアセットストラテジーファンド2016-04<適格機関投資家限定>	1,803,118円
SMAM・マルチアセットストラテジー・オープン<適格機関投資家限定>	2,321,567円
SMAM・マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンド <適格機関投資家限定>	74,738,213円
合計	72,186,242,919円

(2023年11月30日現在)

開示対象ファンドの

期首における当該親投資信託の元本額	72,186,242,919円
同期中における追加設定元本額	18,357,964,761円
同期中における一部解約元本額	9,492,175,074円
2023年11月30日現在の元本の内訳	
三井住友・DC外国株式インデックスファンドS	40,993,532,445円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	284,367,476円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	1,101,912,635円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	824,925,641円
S M A M・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	31,803,096円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020(4資産タイプ)	809,182円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025(4資産タイプ)	4,287,286円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2030(4資産タイプ)	13,864,389円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2035(4資産タイプ)	44,327,375円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040(4資産タイプ)	53,201,554円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045(4資産タイプ)	112,627,999円
外国株式指数ファンド	1,023,969,577円
三井住友・DCつみたてN I S A・全海外株インデックスファンド	21,741,516,631円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	31,711,655円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	78,665,753円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	47,802,122円
イオン・バランス戦略ファンド	16,682,579円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2050	25,577,368円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	144,439,096円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	132,408,735円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	516,674,455円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	304,111,742円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	415,113,239円
三井住友・DCつみたてN I S A・世界分散ファンド	62,415,696円
三井住友D S・外国株式インデックス年金ファンド	2,365,310,413円
三井住友D S・年金バランス30(債券重点型)	10,909,978円
三井住友D S・年金バランス50(標準型)	55,882,152円
三井住友D S・年金バランス70(株式重点型)	52,967,585円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2060	3,054,592円
S M B C・DCインデックスファンド(M S C Iコクサイ)	1,040,268,126円
日興F W S・先進国株インデックス(為替ヘッジあり)	216,434,937円
日興F W S・先進国株インデックス(為替ヘッジなし)	2,404,003,330円
三井住友D S・先進国株式インデックス・ファンド	110,398,522円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2035	309,886円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2040	227,339円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2045	209,701円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2055	69,177円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2065	117,577円
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル1(保守型)	141,347円
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル2(安定型)	2,079,027円
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル3(安定成長型)	9,297,239円
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル4(成長型)	5,432,744円
三井住友D S・FW専用ポートフォリオ・レベル5(積極成長型)	2,398,858円

SMAM・外国株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	334,360,590円
バランスファンドVA(安定運用型)<適格機関投資家限定>	2,083,168円
SMAM・バランスファンドVA安定成長型<適格機関投資家限定>	12,733,609円
SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	352,745,446円
SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	563,666,379円
SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	2,492,534,646円
SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	8,325,935円
SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	40,662,080円
SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	372,277,079円
SMAM・バランスファンドVL国際分散型<適格機関投資家限定>	29,673,252円
SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	72,529,431円
SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	356,314,546円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	228,424,293円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	523,702,536円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	179,149円
三井住友・外国株式インデックスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	183,290,958円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	45,029,147円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	5,291,801円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	5,839,402円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	3,468,121円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	12,153,717円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	41,025,891円
SMAM・グローバルバランスファンド(標準型)VA<適格機関投資家限定>	88,244,496円
SMAM・グローバルバランスファンド(債券重視型)VA<適格機関投資家限定>	35,686,410円
SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	148,918,344円
SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定>	52,597,055円
SMAM・外国株式インデックスファンドSA<適格機関投資家限定>	667,223,190円
SMAM・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	24,515,733円
SMAM・マルチアセットストラテジーファンド2016-04<適格機関投資家限定>	15,507,627円
SMAM・マルチアセットストラテジー・オープン<適格機関投資家限定>	24,710,830円
SMAM・マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンド<適格機関投資家限定>	12,302,074円
SMDAM・年金Wリスクコントロールファンド(リスク3%)<適格機関投資家限定>	9,755,415円
合計	81,052,032,606円

## (3) 附属明細表

## 有価証券明細表

## (a) 株式

通貨	銘柄	株数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル	APA CORP	19,759	36.310	717,449.29	
	BAKER HUGHES CO	78,082	33.340	2,603,253.88	
	CHENIERE ENERGY INC	17,754	180.440	3,203,531.76	
	CHESAPEAKE ENERGY CORP	7,695	79.765	613,791.67	

CHEVRON CORP	136,457	143.910	19,637,526.87	
CONOCOPHILLIPS	91,705	113.970	10,451,618.85	
COTERRA ENERGY INC	59,741	26.090	1,558,642.69	
DEVON ENERGY CORP	49,897	44.880	2,239,377.36	
DIAMONDBACK ENERGY INC	13,065	153.790	2,009,266.35	
EOG RESOURCES INC	43,830	123.240	5,401,609.20	
EQT CORP	26,411	39.750	1,049,837.25	
EXXON MOBIL CORP	300,185	102.340	30,720,932.90	
HALLIBURTON CO	67,581	37.300	2,520,771.30	
HESS CORP	21,198	139.560	2,958,392.88	
HF SINCLAIR CORP	10,663	52.730	562,259.99	
KINDER MORGAN INC	156,197	17.320	2,705,332.04	
MARATHON OIL CORP	42,380	25.300	1,072,214.00	
MARATHON PETROLEUM CORP	32,636	147.420	4,811,199.12	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	51,961	60.330	3,134,807.13	
ONEOK INC	43,615	67.390	2,939,214.85	
OVINTIV INC	16,672	43.920	732,234.24	
PHILLIPS 66	33,814	122.220	4,132,747.08	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	17,516	229.880	4,026,578.08	
SCHLUMBERGER LTD	105,197	51.870	5,456,568.39	
TARGA RESOURCES CORP	15,416	88.010	1,356,762.16	
TEXAS PACIFIC LAND CORP	417	1,652.070	688,913.19	
VALERO ENERGY CORP	26,805	124.080	3,325,964.40	
WILLIAMS COS INC	92,048	36.440	3,354,229.12	
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	17,056	266.480	4,545,082.88	
ALBEMARLE CORP	8,338	123.380	1,028,742.44	
AMCOR PLC	97,610	9.490	926,318.90	
AVERY DENNISON CORP	5,454	192.360	1,049,131.44	
BALL CORP	23,469	54.820	1,286,570.58	
CELANESE CORP	8,742	137.440	1,201,500.48	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	14,020	74.750	1,047,995.00	
CLEVELAND-CLIFFS INC	33,403	16.900	564,510.70	
CORTEVA INC	53,900	45.500	2,452,450.00	
CROWN HOLDINGS INC	9,413	84.070	791,350.91	
DOW INC	53,862	51.330	2,764,736.46	
DUPONT DE NEMOURS INC	34,201	71.440	2,443,319.44	
EASTMAN CHEMICAL CO	9,517	83.190	791,719.23	
ECOLAB INC	19,574	188.630	3,692,243.62	
FMC CORP	8,548	52.680	450,308.64	
FREEPORT-MCMORAN INC	106,789	37.170	3,969,347.13	
INTERNATIONAL PAPER CO	23,472	35.790	840,062.88	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	17,659	75.230	1,328,486.57	
LINDE PLC	36,966	411.390	15,207,442.74	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	19,214	94.000	1,806,116.00	



MARTIN MARIETTA MATERIALS	4,759	462.730	2,202,132.07	
MOSAIC CO/THE	25,489	36.420	928,309.38	
NEWMONT CORP	86,338	40.380	3,486,328.44	
NUCOR CORP	18,997	163.780	3,111,328.66	
PACKAGING CORP OF AMERICA	7,111	161.850	1,150,915.35	
PPG INDUSTRIES INC	16,735	139.550	2,335,369.25	
RELIANCE STEEL & ALUMINUM	4,056	270.250	1,096,134.00	
RPM INTERNATIONAL INC	10,397	101.260	1,052,800.22	
SEALED AIR CORP	13,326	33.160	441,890.16	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	18,266	273.720	4,999,769.52	
STEEL DYNAMICS INC	12,713	115.490	1,468,224.37	
VULCAN MATERIALS CO	9,892	212.680	2,103,830.56	
WESTLAKE CORP	2,189	128.770	281,877.53	
WESTROCK CO	16,766	40.100	672,316.60	
3M CO	42,482	98.470	4,183,202.54	
AECOM	10,261	87.800	900,915.80	
AERCAP HOLDINGS NV	13,505	66.480	897,812.40	
ALLEGION PLC	6,843	104.590	715,709.37	
AMETEK INC	16,587	152.880	2,535,820.56	
AXON ENTERPRISE INC	4,672	225.860	1,055,217.92	
BOEING CO/THE	43,359	224.430	9,731,060.37	
BUILDERS FIRSTSOURCE INC	9,801	134.890	1,322,056.89	
CARLISLE COS INC	3,499	275.110	962,609.89	
CARRIER GLOBAL CORP	61,324	52.210	3,201,726.04	
CATERPILLAR INC	39,051	249.450	9,741,271.95	
CUMMINS INC	10,159	223.950	2,275,108.05	
DEERE & CO	20,718	363.940	7,540,108.92	
DOVER CORP	10,436	140.770	1,469,075.72	
EATON CORP PLC	29,468	225.800	6,653,874.40	
EMERSON ELECTRIC CO	41,763	88.310	3,688,090.53	
FASTENAL CO	41,551	59.640	2,478,101.64	
FERGUSON PLC	16,077	168.680	2,711,868.36	
FORTIVE CORP	25,083	67.710	1,698,369.93	
FORTUNE BRANDS INNOVATIONS I	10,648	68.040	724,489.92	
GENERAC HOLDINGS INC	3,973	115.600	459,278.80	
GENERAL DYNAMICS CORP	17,778	244.830	4,352,587.74	
GENERAL ELECTRIC CO	82,651	118.860	9,823,897.86	
GRACO INC	11,645	80.100	932,764.50	
HEICO CORP	3,085	168.770	520,655.45	
HEICO CORP-CLASS A	4,570	135.990	621,474.30	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	50,521	194.260	9,814,209.46	
HOWMET AEROSPACE INC	27,783	51.590	1,433,324.97	
HUBBELL INC	3,897	294.660	1,148,290.02	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	2,888	233.750	675,070.00	

IDEX CORP	6,048	198.300	1,199,318.40	
ILLINOIS TOOL WORKS	23,264	240.830	5,602,669.12	
INGERSOLL-RAND INC	29,314	69.600	2,040,254.40	
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	11,600	39.460	457,736.00	
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	52,470	52.760	2,768,317.20	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	14,388	188.660	2,714,440.08	
LENNOX INTERNATIONAL INC	2,104	401.150	844,019.60	
LOCKHEED MARTIN CORP	17,095	445.010	7,607,445.95	
MASCO CORP	14,885	60.370	898,607.45	
NORDSON CORP	3,927	232.600	913,420.20	
NORTHROP GRUMMAN CORP	10,937	467.410	5,112,063.17	
OTIS WORLDWIDE CORP	31,838	84.330	2,684,898.54	
OWENS CORNING	7,597	134.140	1,019,061.58	
PACCAR INC	39,980	91.310	3,650,573.80	
PARKER HANNIFIN CORP	9,607	428.060	4,112,372.42	
PENTAIR PLC	11,509	63.720	733,353.48	
QUANTA SERVICES INC	10,416	185.610	1,933,313.76	
ROCKWELL AUTOMATION INC	8,678	270.560	2,347,919.68	
RTX CORP	110,909	80.950	8,978,083.55	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	12,538	32.370	405,855.06	
SMITH (A.O.) CORP	10,652	75.100	799,965.20	
SNAP-ON INC	4,041	271.840	1,098,505.44	
STANLEY BLACK & DECKER INC	10,869	91.460	994,078.74	
TEXTRON INC	14,870	74.830	1,112,722.10	
TORO CO	8,097	82.510	668,083.47	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	17,225	222.630	3,834,801.75	
TRANSDIGM GROUP INC	4,165	952.820	3,968,495.30	
UNITED RENTALS INC	5,383	476.220	2,563,492.26	
WABTEC CORP	12,782	115.200	1,472,486.40	
WATSCO INC	2,364	380.450	899,383.80	
WW GRAINGER INC	3,504	775.690	2,718,017.76	
XYLEM INC	16,831	103.500	1,742,008.50	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	30,587	229.160	7,009,316.92	
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	10,637	124.470	1,323,987.39	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	8,963	190.640	1,708,706.32	
CERIDIAN HCM HOLDING INC	10,485	69.130	724,828.05	
CINTAS CORP	6,998	549.080	3,842,461.84	
CLARIVATE PLC	19,939	7.700	153,530.30	
COPART INC	62,164	50.220	3,121,876.08	
EQUIFAX INC	9,133	216.600	1,978,207.80	
JACOBS SOLUTIONS INC	10,393	126.200	1,311,596.60	
LEIDOS HOLDINGS INC	8,863	106.220	941,427.86	
PAYCHEX INC	24,917	121.150	3,018,694.55	
PAYCOM SOFTWARE INC	3,778	181.290	684,913.62	

PAYLOCITY HOLDING CORP	2,718	155.030	421,371.54	
REPUBLIC SERVICES INC	16,065	159.930	2,569,275.45	
ROBERT HALF INC	8,149	80.500	655,994.50	
ROLLINS INC	16,081	40.190	646,295.39	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	14,487	56.000	811,272.00	
TRANSUNION	14,503	58.790	852,631.37	
VERALTO CORP	17,640	74.220	1,309,240.80	
VERISK ANALYTICS INC	11,354	238.260	2,705,204.04	
WASTE CONNECTIONS INC	20,167	132.640	2,674,950.88	
WASTE MANAGEMENT INC	30,236	169.740	5,132,258.64	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	8,726	81.570	711,779.82	
CSX CORP	154,835	31.730	4,912,914.55	
DELTA AIR LINES INC	14,192	36.640	519,994.88	
EXPEDITORS INTL WASH INC	10,436	119.520	1,247,310.72	
FEDEX CORP	18,074	253.930	4,589,530.82	
GRAB HOLDINGS LTD - CL A	159,485	3.080	491,213.80	
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	6,308	182.050	1,148,371.40	
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	12,089	53.230	643,497.47	
NORFOLK SOUTHERN CORP	17,033	215.080	3,663,457.64	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	7,677	383.910	2,947,277.07	
SOUTHWEST AIRLINES CO	14,057	25.330	356,063.81	
UBER TECHNOLOGIES INC	138,131	56.400	7,790,588.40	
U-HAUL HOLDING CO-NON VOTING	5,850	53.650	313,852.50	
UNION PACIFIC CORP	45,563	221.470	10,090,837.61	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	54,032	152.290	8,228,533.28	
APTIV PLC	21,117	82.270	1,737,295.59	
BORGWARNER INC	17,433	34.160	595,511.28	
FORD MOTOR CO	299,200	10.590	3,168,528.00	
GENERAL MOTORS CO	104,301	31.600	3,295,911.60	
LEAR CORP	3,736	134.810	503,650.16	
LUCID GROUP INC	82,293	4.360	358,797.48	
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	45,698	17.320	791,489.36	
TESLA INC	214,241	244.140	52,304,797.74	
DECKERS OUTDOOR CORP	1,872	654.990	1,226,141.28	
DR HORTON INC	24,030	127.260	3,058,057.80	
GARMIN LTD	10,774	121.000	1,303,654.00	
HASBRO INC	11,407	46.430	529,627.01	
LENNAR CORP-A	19,331	126.840	2,451,944.04	
LULULEMON ATHLETICA INC	8,357	438.350	3,663,290.95	
MOHAWK INDUSTRIES INC	2,863	87.800	251,371.40	
NIKE INC -CL B	93,516	110.370	10,321,360.92	
NVR INC	250	6,107.110	1,526,777.50	
PULTEGROUP INC	17,535	88.010	1,543,255.35	
VF CORP	20,583	17.130	352,586.79	

WHIRLPOOL CORP	4,975	109.630	545,409.25	
AIRBNB INC-CLASS A	31,310	126.480	3,960,088.80	
ARAMARK	19,232	27.780	534,264.96	
BOOKING HOLDINGS INC	2,788	3,126.290	8,716,096.52	
CAESARS ENTERTAINMENT INC	15,881	45.030	715,121.43	
CARNIVAL CORP	69,745	14.910	1,039,897.95	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2,100	2,189.110	4,597,131.00	
DARDEN RESTAURANTS INC	9,323	155.730	1,451,870.79	
DOMINO'S PIZZA INC	2,875	388.860	1,117,972.50	
DOORDASH INC - A	20,142	94.960	1,912,684.32	
DRAFTKINGS INC-CL A	32,265	38.270	1,234,781.55	
EXPEDIA GROUP INC	10,081	135.750	1,368,495.75	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	19,380	166.660	3,229,870.80	
HYATT HOTELS CORP - CL A	3,371	113.810	383,653.51	
LAS VEGAS SANDS CORP	27,977	45.340	1,268,477.18	
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	19,665	202.480	3,981,769.20	
MCDONALD'S CORP	54,294	280.380	15,222,951.72	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	22,198	39.430	875,267.14	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	16,097	105.910	1,704,833.27	
STARBUCKS CORP	87,125	99.850	8,699,431.25	
VAIL RESORTS INC	2,860	215.220	615,529.20	
WYNN RESORTS LTD	7,730	83.670	646,769.10	
YUM! BRANDS INC	20,179	125.520	2,532,868.08	
AMAZON.COM INC	692,035	146.320	101,258,561.20	
AUTOZONE INC	1,315	2,596.510	3,414,410.65	
BATH & BODY WORKS INC	15,400	32.050	493,570.00	
BEST BUY CO INC	14,954	70.780	1,058,444.12	
BURLINGTON STORES INC	4,802	171.520	823,639.04	
CARMAX INC	10,366	63.160	654,716.56	
CHEWY INC - CLASS A	13,119	17.730	232,599.87	
DICK'S SPORTING GOODS INC	4,406	127.950	563,747.70	
EBAY INC	40,534	40.640	1,647,301.76	
ETSY INC	9,090	77.200	701,748.00	
GENUINE PARTS CO	10,245	133.860	1,371,395.70	
GLOBAL-E ONLINE LTD	8,896	34.370	305,755.52	
HOME DEPOT INC	75,103	311.020	23,358,535.06	
LKQ CORP	18,982	44.390	842,610.98	
LOWE'S COS INC	43,814	199.920	8,759,294.88	
MERCADOLIBRE INC	3,384	1,610.580	5,450,202.72	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	4,512	973.940	4,394,417.28	
POOL CORP	3,252	345.320	1,122,980.64	
ROSS STORES INC	24,702	129.200	3,191,498.40	
TJX COMPANIES INC	85,065	88.100	7,494,226.50	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	8,071	200.190	1,615,733.49	

ULTA BEAUTY INC	3,734	420.010	1,568,317.34	
ALBERTSONS COS INC - CLASS A	20,378	21.300	434,051.40	
COSTCO WHOLESALE CORP	33,432	587.860	19,653,335.52	
DOLLAR GENERAL CORP	15,800	128.880	2,036,304.00	
DOLLAR TREE INC	15,923	121.120	1,928,593.76	
KROGER CO	49,890	43.640	2,177,199.60	
SYSCO CORP	36,352	71.710	2,606,801.92	
TARGET CORP	34,331	131.320	4,508,346.92	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	52,808	19.980	1,055,103.84	
WALMART INC	111,744	156.080	17,441,003.52	
ALTRIA GROUP INC	134,504	41.760	5,616,887.04	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	42,289	73.190	3,095,131.91	
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	22,643	58.230	1,318,501.89	
BUNGE GLOBAL SA	12,343	108.100	1,334,278.30	
CAMPBELL SOUP CO	12,945	39.760	514,693.20	
COCA-COLA CO/THE	309,873	58.230	18,043,904.79	
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	15,803	59.700	943,439.10	
CONAGRA BRANDS INC	39,722	28.020	1,113,010.44	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	12,701	237.950	3,022,202.95	
DARLING INGREDIENTS INC	10,514	41.640	437,802.96	
GENERAL MILLS INC	42,268	62.590	2,645,554.12	
HERSHEY CO/THE	11,180	185.720	2,076,349.60	
HORMEL FOODS CORP	25,536	30.470	778,081.92	
JM SMUCKER CO/THE	8,172	108.580	887,315.76	
KELLANOVA	19,503	51.660	1,007,524.98	
KEURIG DR PEPPER INC	68,147	31.730	2,162,304.31	
KRAFT HEINZ CO/THE	62,228	35.080	2,182,958.24	
LAMB WESTON HOLDINGS INC	10,534	97.530	1,027,381.02	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	18,425	64.280	1,184,359.00	
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	12,477	60.100	749,867.70	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	100,607	70.440	7,086,757.08	
MONSTER BEVERAGE CORP	60,052	54.710	3,285,444.92	
PEPSICO INC	103,827	167.160	17,355,721.32	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	117,573	93.650	11,010,711.45	
TYSON FOODS INC-CL A	19,731	47.090	929,132.79	
CHURCH & DWIGHT CO INC	17,113	94.660	1,619,916.58	
CLOROX COMPANY	9,104	142.340	1,295,863.36	
COLGATE-PALMOLIVE CO	58,956	77.880	4,591,493.28	
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	17,009	125.600	2,136,330.40	
KENVUE INC	112,611	20.080	2,261,228.88	
KIMBERLY-CLARK CORP	25,378	121.770	3,090,279.06	
PROCTER & GAMBLE CO/THE	177,416	151.130	26,812,880.08	
ABBOTT LABORATORIES	131,477	103.630	13,624,961.51	
ALIGN TECHNOLOGY INC	5,703	216.480	1,234,585.44	

BAXTER INTERNATIONAL INC	39,241	36.400	1,428,372.40	
BECTON DICKINSON AND CO	21,072	235.690	4,966,459.68	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	106,596	55.440	5,909,682.24	
CARDINAL HEALTH INC	18,000	105.300	1,895,400.00	
CENCORA INC	12,209	199.520	2,435,939.68	
CENTENE CORP	40,300	70.480	2,840,344.00	
COOPER COS INC/THE	3,384	331.590	1,122,100.56	
CVS HEALTH CORP	96,086	66.900	6,428,153.40	
DAVITA INC	4,138	99.610	412,186.18	
DENTSPLY SIRONA INC	17,715	31.330	555,010.95	
DEXCOM INC	30,245	116.180	3,513,864.10	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	44,049	67.430	2,970,224.07	
ELEVANCE HEALTH INC	17,496	465.360	8,141,938.56	
GE HEALTHCARE TECHNOLOGY	31,160	67.710	2,109,843.60	
HCA HEALTHCARE INC	15,058	249.080	3,750,646.64	
HENRY SCHEIN INC	10,457	66.660	697,063.62	
HOLOGIC INC	19,730	70.600	1,392,938.00	
HUMANA INC	9,498	482.410	4,581,930.18	
IDEXX LABORATORIES INC	6,043	466.740	2,820,509.82	
INSULET CORP	5,082	188.920	960,091.44	
INTUITIVE SURGICAL INC	26,647	310.760	8,280,821.72	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	6,245	214.090	1,336,992.05	
MCKESSON CORP	10,067	456.700	4,597,598.90	
MEDTRONIC PLC	101,168	78.860	7,978,108.48	
MOLINA HEALTHCARE INC	4,673	350.820	1,639,381.86	
QUEST DIAGNOSTICS INC	7,645	135.270	1,034,139.15	
RESMED INC	10,758	158.850	1,708,908.30	
STERIS PLC	7,525	197.440	1,485,736.00	
STRYKER CORP	25,167	294.370	7,408,409.79	
TELEFLEX INC	3,067	221.250	678,573.75	
THE CIGNA GROUP	22,335	262.870	5,871,201.45	
UNITEDHEALTH GROUP INC	70,017	534.980	37,457,694.66	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	4,203	135.750	570,557.25	
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	10,315	173.360	1,788,208.40	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	15,537	113.920	1,769,975.04	
ABBVIE INC	133,033	138.500	18,425,070.50	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	23,121	127.590	2,950,008.39	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	9,171	164.010	1,504,135.71	
AMGEN INC	40,506	266.600	10,798,899.60	
AVANTOR INC	56,039	20.860	1,168,973.54	
BIOGEN INC	11,114	232.060	2,579,114.84	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	13,832	89.740	1,241,283.68	
BIO-RAD LABORATORIES-A	1,728	304.490	526,158.72	
BIO-TECHNE CORP	13,296	63.120	839,243.52	

BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	159,354	48.720	7,763,726.88	
CATALENT INC	16,025	39.570	634,109.25	
CHARLES RIVER LABORATORIES	3,467	197.100	683,345.70	
DANAHER CORP	52,921	222.520	11,775,980.92	
ELI LILLY & CO	60,686	591.860	35,917,615.96	
EXACT SCIENCES CORP	13,570	65.060	882,864.20	
GILEAD SCIENCES INC	92,189	75.230	6,935,378.47	
ILLUMINA INC	11,573	101.570	1,175,469.61	
INCYTE CORP	15,899	53.390	848,847.61	
IQVIA HOLDINGS INC	14,439	213.810	3,087,202.59	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	4,089	114.260	467,209.14	
JOHNSON & JOHNSON	180,442	152.110	27,447,032.62	
MERCK & CO. INC.	191,252	101.130	19,341,314.76	
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	1,691	1,092.430	1,847,299.13	
MODERNA INC	23,790	79.010	1,879,647.90	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	6,359	113.540	722,000.86	
PFIZER INC	419,949	30.080	12,632,065.92	
REGENERON PHARMACEUTICALS	8,098	808.590	6,547,961.82	
REPLIGEN CORP	3,456	159.490	551,197.44	
REVVITY INC	10,411	89.410	930,847.51	
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	27,162	26.900	730,657.80	
SEAGEN INC	10,328	213.520	2,205,234.56	
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	82,214	9.690	796,653.66	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	28,688	492.920	14,140,888.96	
UNITED THERAPEUTICS CORP	3,537	232.070	820,831.59	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	19,346	351.000	6,790,446.00	
VIATRIS INC	83,466	9.130	762,044.58	
WATERS CORP	4,095	279.740	1,145,535.30	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	5,276	348.920	1,840,901.92	
ZOETIS INC	34,274	175.790	6,025,026.46	
BANK OF AMERICA CORP	541,247	30.310	16,405,196.57	
CITIGROUP INC	143,867	45.750	6,581,915.25	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	36,122	27.240	983,963.28	
FIFTH THIRD BANCORP	49,541	28.410	1,407,459.81	
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	845	1,442.370	1,218,802.65	
FIRST HORIZON CORP	39,014	12.650	493,527.10	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	105,007	11.130	1,168,727.91	
JPMORGAN CHASE & CO	219,809	154.320	33,920,924.88	
KEYCORP	62,741	12.440	780,498.04	
M & T BANK CORP	12,629	127.730	1,613,102.17	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	30,337	132.380	4,016,012.06	
REGIONS FINANCIAL CORP	62,979	16.470	1,037,264.13	
TRUIST FINANCIAL CORP	101,687	32.130	3,267,203.31	
US BANCORP	116,120	37.790	4,388,174.80	

WEBSTER FINANCIAL CORP	13,918	44.540	619,907.72	
WELLS FARGO & CO	275,847	43.780	12,076,581.66	
ALLY FINANCIAL INC	20,139	28.640	576,780.96	
AMERICAN EXPRESS CO	47,398	167.430	7,935,847.14	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	7,978	348.350	2,779,136.30	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	31,181	92.270	2,877,070.87	
ARES MANAGEMENT CORP - A	11,370	111.150	1,263,775.50	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	61,100	47.550	2,905,305.00	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	97,122	358.690	34,836,690.18	
BLACKROCK INC	11,045	747.300	8,253,928.50	
BLACKSTONE INC	53,294	111.370	5,935,352.78	
BLOCK INC	38,443	63.730	2,449,972.39	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	29,775	110.130	3,279,120.75	
CARLYLE GROUP INC/THE	16,730	34.520	577,519.60	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	7,323	179.500	1,314,478.50	
CME GROUP INC	26,755	214.840	5,748,044.20	
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	13,634	127.820	1,742,697.88	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	18,645	88.890	1,657,354.05	
EQUITABLE HOLDINGS INC	22,820	29.960	683,687.20	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	2,946	454.390	1,338,632.94	
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	42,749	58.180	2,487,136.82	
FISERV INC	46,955	129.360	6,074,098.80	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	5,089	237.230	1,207,263.47	
FRANKLIN RESOURCES INC	21,778	24.590	535,521.02	
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	6,533	54.540	356,309.82	
GLOBAL PAYMENTS INC	20,594	116.360	2,396,317.84	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	24,977	340.260	8,498,674.02	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	41,649	112.690	4,693,425.81	
INVESCO LTD	18,328	14.280	261,723.84	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	4,971	156.010	775,525.71	
KKR & CO INC	47,224	74.740	3,529,521.76	
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	6,164	216.820	1,336,478.48	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	2,653	237.090	628,999.77	
MASTERCARD INC - A	63,063	409.820	25,844,478.66	
MOODY'S CORP	12,518	361.890	4,530,139.02	
MORGAN STANLEY	92,428	78.550	7,260,219.40	
MSCI INC	6,223	526.570	3,276,845.11	
NASDAQ INC	27,999	55.700	1,559,544.30	
NORTHERN TRUST CORP	16,793	78.280	1,314,556.04	
PAYPAL HOLDINGS INC	80,330	57.970	4,656,730.10	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	14,529	103.750	1,507,383.75	
ROBINHOOD MARKETS INC - A	31,965	8.920	285,127.80	
S&P GLOBAL INC	24,887	414.640	10,319,145.68	
SCHWAB (CHARLES) CORP	111,107	59.610	6,623,088.27	



SEI INVESTMENTS COMPANY	7,550	57.880	436,994.00	
STATE STREET CORP	25,474	71.740	1,827,504.76	
SYNCHRONY FINANCIAL	32,112	31.220	1,002,536.64	
T ROWE PRICE GROUP INC	17,303	99.160	1,715,765.48	
TOAST INC-CLASS A	21,393	15.270	326,671.11	
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	8,688	95.010	825,446.88	
VISA INC-CLASS A SHARES	121,762	254.230	30,955,553.26	
AFLAC INC	44,628	81.630	3,642,983.64	
ALLSTATE CORP	20,503	135.490	2,777,951.47	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	4,866	110.870	539,493.42	
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	55,264	64.830	3,582,765.12	
AON PLC-CLASS A	14,865	322.100	4,788,016.50	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	29,061	82.380	2,394,045.18	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	16,577	245.020	4,061,696.54	
ASSURANT INC	3,114	163.800	510,073.20	
BROWN & BROWN INC	18,424	72.970	1,344,399.28	
CHUBB LTD	31,161	225.080	7,013,717.88	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	10,510	100.660	1,057,936.60	
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	2,244	286.970	643,960.68	
EVEREST GROUP LTD	3,547	402.340	1,427,099.98	
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	19,058	44.390	845,984.62	
GLOBE LIFE INC	6,373	120.260	766,416.98	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	21,767	76.980	1,675,623.66	
LOEWS CORP	12,727	68.510	871,926.77	
MARKEL GROUP INC	957	1,415.160	1,354,308.12	
MARSH & MCLENNAN COS	36,569	196.330	7,179,591.77	
METLIFE INC	47,592	63.160	3,005,910.72	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	19,458	74.170	1,443,199.86	
PROGRESSIVE CORP	43,469	163.000	7,085,447.00	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	27,229	96.600	2,630,321.40	
TRAVELERS COS INC/THE	16,719	177.440	2,966,619.36	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	7,897	240.770	1,901,360.69	
WR BERKLEY CORP	14,486	70.570	1,022,277.02	
ACCENTURE PLC-CL A	47,644	333.340	15,881,650.96	
ADOBE INC	34,076	617.390	21,038,181.64	
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	10,300	115.700	1,191,710.00	
ANSYS INC	6,763	298.860	2,021,190.18	
ASPEN TECHNOLOGY INC	1,901	186.580	354,688.58	
ATLASSIAN CORP-CL A	10,941	195.550	2,139,512.55	
AUTODESK INC	16,146	213.850	3,452,822.10	
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	18,166	52.630	956,076.58	
BILL HOLDINGS INC	6,004	67.940	407,911.76	
CADENCE DESIGN SYS INC	20,318	275.210	5,591,716.78	
CHECK POINT SOFTWARE TECH	7,561	146.170	1,105,191.37	

CLOUDFLARE INC - CLASS A	19,210	78.310	1,504,335.10	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	36,763	70.120	2,577,821.56	
CONFLUENT INC-CLASS A	15,954	21.220	338,543.88	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	16,959	234.440	3,975,867.96	
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	3,173	199.260	632,251.98	
DATADOG INC - CLASS A	18,911	116.650	2,205,968.15	
DOCUSIGN INC	17,164	43.620	748,693.68	
DROPBOX INC-CLASS A	16,584	28.080	465,678.72	
DYNATRACE INC	15,753	53.430	841,682.79	
EPAM SYSTEMS INC	4,815	261.980	1,261,433.70	
FAIR ISAAC CORP	1,871	1,075.100	2,011,512.10	
FORTINET INC	47,604	53.600	2,551,574.40	
GARTNER INC	6,179	430.120	2,657,711.48	
GEN DIGITAL INC	41,779	21.770	909,528.83	
GODADDY INC - CLASS A	11,895	97.920	1,164,758.40	
HUBSPOT INC	3,318	496.520	1,647,453.36	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	68,871	156.410	10,772,113.11	
INTUIT INC	21,212	577.230	12,244,202.76	
MANHATTAN ASSOCIATES INC	4,648	223.610	1,039,339.28	
MICROSOFT CORP	529,731	378.850	200,688,589.35	
MONDAY.COM LTD	1,879	175.000	328,825.00	
MONGODB INC	5,236	420.510	2,201,790.36	
OKTA INC	10,337	70.770	731,549.49	
ORACLE CORP	122,999	116.210	14,293,713.79	
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	128,742	19.840	2,554,241.28	
PALO ALTO NETWORKS INC	22,821	288.910	6,593,215.11	
PTC INC	9,246	155.490	1,437,660.54	
ROPER TECHNOLOGIES INC	8,088	525.830	4,252,913.04	
SALESFORCE INC	73,560	230.350	16,944,546.00	
SERVICENOW INC	15,473	678.930	10,505,083.89	
SNOWFLAKE INC-CLASS A	20,323	175.320	3,563,028.36	
SPLUNK INC	12,234	150.600	1,842,440.40	
SYNOPSYS INC	11,669	552.460	6,446,655.74	
TWILIO INC - A	10,905	66.130	721,147.65	
TYLER TECHNOLOGIES INC	3,139	407.310	1,278,546.09	
UIPATH INC - CLASS A	25,298	19.870	502,671.26	
UNITY SOFTWARE INC	19,066	30.360	578,843.76	
VERISIGN INC	6,425	211.700	1,360,172.50	
WIX.COM LTD	4,119	102.110	420,591.09	
WORKDAY INC-CLASS A	15,569	263.490	4,102,275.81	
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	18,307	67.950	1,243,960.65	
ZSCALER INC	6,271	199.840	1,253,196.64	
AMPHENOL CORP-CL A	45,311	90.180	4,086,145.98	
APPLE INC	1,178,730	189.370	223,216,100.10	

ARISTA NETWORKS INC	20,286	219.300	4,448,719.80	
ARROW ELECTRONICS INC	4,130	119.580	493,865.40	
CDW CORP/DE	9,855	212.090	2,090,146.95	
CISCO SYSTEMS INC	304,623	48.050	14,637,135.15	
COGNEX CORP	11,368	37.610	427,550.48	
CORNING INC	58,470	28.220	1,650,023.40	
DELL TECHNOLOGIES -C	18,797	75.060	1,410,902.82	
F5 INC	3,921	170.050	666,766.05	
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	102,647	16.520	1,695,728.44	
HP INC	66,419	29.070	1,930,800.33	
JABIL INC	9,808	115.240	1,130,273.92	
JUNIPER NETWORKS INC	21,151	28.040	593,074.04	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	13,320	137.880	1,836,561.60	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	12,784	319.040	4,078,607.36	
NETAPP INC	17,045	89.540	1,526,209.30	
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	13,715	78.480	1,076,353.20	
SUPER MICRO COMPUTER INC	3,540	287.630	1,018,210.20	
TE CONNECTIVITY LTD	23,194	130.430	3,025,193.42	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	3,432	399.100	1,369,711.20	
TRIMBLE INC	20,783	45.920	954,355.36	
WESTERN DIGITAL CORP	24,533	47.320	1,160,901.56	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	4,189	236.620	991,201.18	
ADVANCED MICRO DEVICES	121,818	123.850	15,087,159.30	
ANALOG DEVICES INC	37,327	182.710	6,820,016.17	
APPLIED MATERIALS INC	62,167	149.360	9,285,263.12	
BROADCOM INC	33,229	940.830	31,262,840.07	
ENPHASE ENERGY INC	10,381	100.960	1,048,065.76	
ENTEGRIS INC	9,961	104.510	1,041,024.11	
FIRST SOLAR INC	6,859	155.430	1,066,094.37	
INTEL CORP	316,085	44.940	14,204,859.90	
KLA CORP	10,049	544.070	5,467,359.43	
LAM RESEARCH CORP	10,243	713.990	7,313,399.57	
LATTICE SEMICONDUCTOR CORP	11,073	59.060	653,971.38	
MARVELL TECHNOLOGY INC	65,112	56.100	3,652,783.20	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	40,124	82.980	3,329,489.52	
MICRON TECHNOLOGY INC	81,266	76.690	6,232,289.54	
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	3,399	552.460	1,877,811.54	
NVIDIA CORP	185,105	481.400	89,109,547.00	
NXP SEMICONDUCTORS NV	19,715	204.330	4,028,365.95	
ON SEMICONDUCTOR	31,206	71.620	2,234,973.72	
QORVO INC	7,835	95.890	751,298.15	
QUALCOMM INC	83,212	127.910	10,643,646.92	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	10,677	96.000	1,024,992.00	
SOLAREEDGE TECHNOLOGIES INC	4,104	78.550	322,369.20	

TERADYNE INC	10,642	92.760	987,151.92	
TEXAS INSTRUMENTS INC	68,725	153.200	10,528,670.00	
WOLFSPEED INC	8,461	36.250	306,711.25	
AT&T INC	534,592	16.300	8,713,849.60	
LIBERTY GLOBAL LTD-C	21,079	16.890	356,024.31	
T-MOBILE US INC	41,344	149.550	6,182,995.20	
VERIZON COMMUNICATIONS INC	318,519	37.760	12,027,277.44	
AES CORP	54,086	17.220	931,360.92	
ALLIANT ENERGY CORP	21,204	49.940	1,058,927.76	
AMEREN CORPORATION	19,979	76.990	1,538,183.21	
AMERICAN ELECTRIC POWER	37,302	79.215	2,954,877.93	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	15,191	131.220	1,993,363.02	
ATMOS ENERGY CORP	10,802	112.050	1,210,364.10	
CENTERPOINT ENERGY INC	44,329	27.890	1,236,335.81	
CMS ENERGY CORP	20,578	56.750	1,167,801.50	
CONSOLIDATED EDISON INC	25,230	89.940	2,269,186.20	
CONSTELLATION ENERGY	25,008	120.580	3,015,464.64	
DOMINION ENERGY INC	60,534	46.730	2,828,753.82	
DTE ENERGY COMPANY	16,277	104.140	1,695,086.78	
DUKE ENERGY CORP	57,237	90.710	5,191,968.27	
EDISON INTERNATIONAL	27,815	65.780	1,829,670.70	
ENTERGY CORP	14,800	100.590	1,488,732.00	
ESSENTIAL UTILITIES INC	16,329	35.370	577,556.73	
EVERGY INC	17,275	50.640	874,806.00	
EVERSOURCE ENERGY	25,375	59.710	1,515,141.25	
EXELON CORP	76,292	38.390	2,928,849.88	
FIRSTENERGY CORP	37,970	36.980	1,404,130.60	
NEXTERA ENERGY INC	151,970	58.360	8,868,969.20	
NISOURCE INC	34,855	25.810	899,607.55	
NRG ENERGY INC	20,349	46.850	953,350.65	
P G & E CORP	149,297	17.170	2,563,429.49	
PPL CORP	55,523	26.030	1,445,263.69	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	37,236	63.290	2,356,666.44	
SEMPRA	48,838	72.950	3,562,732.10	
SOUTHERN CO/THE	80,927	70.230	5,683,503.21	
VISTRA CORP	25,777	34.920	900,132.84	
WEC ENERGY GROUP INC	22,571	82.970	1,872,715.87	
XCEL ENERGY INC	40,756	60.000	2,445,360.00	
ALPHABET INC-CL A	445,227	134.990	60,101,192.73	
ALPHABET INC-CL C	396,590	136.400	54,094,876.00	
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	7,601	398.900	3,032,038.90	
COMCAST CORP-CLASS A	313,150	41.630	13,036,434.50	
ELECTRONIC ARTS INC	19,428	137.310	2,667,658.68	
FOX CORP - CLASS A	23,886	29.580	706,547.88	

	FOX CORP - CLASS B	8,773	27.690	242,924.37	
	INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	26,027	30.640	797,467.28	
	LIBERTY BROADBAND-C	8,196	82.410	675,432.36	
	LIBERTY MEDIA CORP-LIBER-NEW	12,383	26.940	333,598.02	
	LIBERTY MEDIA CORP-LIB-NEW-C	13,438	63.380	851,700.44	
	LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	11,080	83.600	926,288.00	
	MATCH GROUP INC	17,799	32.480	578,111.52	
	META PLATFORMS INC-CLASS A	165,862	332.200	55,099,356.40	
	NETFLIX INC	33,145	477.190	15,816,462.55	
	NEWS CORP - CLASS A	23,102	22.340	516,098.68	
	OMNICOM GROUP	15,106	79.790	1,205,307.74	
	PARAMOUNT GLOBAL-CLASS B	40,964	14.410	590,291.24	
	PINTEREST INC- CLASS A	48,115	33.280	1,601,267.20	
	ROBLOX CORP -CLASS A	29,846	38.680	1,154,443.28	
	ROKU INC	9,945	106.750	1,061,628.75	
	SEA LTD-ADR	28,149	36.740	1,034,194.26	
	SIRIUS XM HOLDINGS INC	56,550	4.700	265,785.00	
	SNAP INC - A	70,689	12.980	917,543.22	
	TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	12,652	157.010	1,986,490.52	
	TRADE DESK INC/THE -CLASS A	32,608	70.370	2,294,624.96	
	WALT DISNEY CO/THE	138,365	92.500	12,798,762.50	
	WARNER BROS DISCOVERY INC	165,916	10.780	1,788,574.48	
	ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC	24,629	14.220	350,224.38	
	CBRE GROUP INC - A	23,502	79.380	1,865,588.76	
	COSTAR GROUP INC	30,836	83.940	2,588,373.84	
	HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	79,100	3.190	252,329.00	
	ZILLOW GROUP INC - C	10,672	42.290	451,318.88	
	アメリカ・ドル小計	25,524,979		2,954,075,940.55 (434,455,948,577)	
カナダ・ドル	ARC RESOURCES LTD	44,923	21.680	973,930.64	
	CAMECO CORP	33,586	60.080	2,017,846.88	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	82,506	90.180	7,440,391.08	
	CENOVUS ENERGY INC	99,824	24.010	2,396,774.24	
	ENBRIDGE INC	155,165	46.920	7,280,341.80	
	IMPERIAL OIL LTD	16,267	78.230	1,272,567.41	
	KEYERA CORP	19,802	32.990	653,267.98	
	PARKLAND CORP	7,666	43.720	335,157.52	
	PEMBINA PIPELINE CORP	37,348	45.040	1,682,153.92	
	SUNCOR ENERGY INC	100,785	44.830	4,518,191.55	
	TC ENERGY CORP	73,652	50.410	3,712,797.32	
	TOURMALINE OIL CORP	26,107	65.330	1,705,570.31	
	AGNICO EAGLE MINES LTD	36,483	72.600	2,648,665.80	
	BARRICK GOLD CORP	125,529	23.640	2,967,505.56	
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	13,268	56.210	745,794.28	

FIRST QUANTUM MINERALS LTD	41,452	11.360	470,894.72	
FRANCO-NEVADA CORP	14,724	154.990	2,282,072.76	
IVANHOE MINES LTD-CL A	56,432	11.020	621,880.64	
KINROSS GOLD CORP	110,156	7.930	873,537.08	
LUNDIN MINING CORP	46,446	9.310	432,412.26	
NUTRIEN LTD	36,792	75.470	2,776,692.24	
PAN AMERICAN SILVER CORP	25,157	21.280	535,340.96	
TECK RESOURCES LTD-CLS B	34,947	50.400	1,761,328.80	
WEST FRASER TIMBER CO LTD	4,438	101.240	449,303.12	
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	34,221	66.680	2,281,856.28	
CAE INC	27,474	26.450	726,687.30	
STANTEC INC	9,939	97.010	964,182.39	
TOROMONT INDUSTRIES LTD	6,027	110.550	666,284.85	
WSP GLOBAL INC	9,260	186.430	1,726,341.80	
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	15,630	37.330	583,467.90	
RB GLOBAL INC	12,520	85.880	1,075,217.60	
THOMSON REUTERS CORP	12,639	189.080	2,389,782.12	
AIR CANADA	12,083	17.450	210,848.35	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	42,942	155.530	6,678,769.26	
CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY	68,555	96.950	6,646,407.25	
TFI INTERNATIONAL INC	5,097	158.710	808,944.87	
MAGNA INTERNATIONAL INC	22,436	73.730	1,654,206.28	
BRP INC/CA- SUB VOTING	3,082	95.000	292,790.00	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	11,302	48.620	549,503.24	
RESTAURANT BRANDS INTERN	21,066	94.690	1,994,739.54	
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	4,737	140.510	665,595.87	
DOLLARAMA INC	20,468	97.400	1,993,583.20	
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	57,969	76.230	4,418,976.87	
EMPIRE CO LTD 'A'	9,148	36.720	335,914.56	
LOBLAW COMPANIES LTD	11,573	120.460	1,394,083.58	
METRO INC/CN	18,929	69.180	1,309,508.22	
WESTON (GEORGE) LTD	4,984	162.170	808,255.28	
SAPUTO INC	18,270	26.050	475,933.50	
BANK OF MONTREAL	53,693	110.100	5,911,599.30	
BANK OF NOVA SCOTIA	88,900	59.710	5,308,219.00	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	64,792	53.360	3,457,301.12	
NATIONAL BANK OF CANADA	25,956	89.520	2,323,581.12	
ROYAL BANK OF CANADA	105,193	118.810	12,497,980.33	
TORONTO-DOMINION BANK	139,736	83.300	11,640,008.80	
BROOKFIELD ASSET MGMT-A	23,555	48.520	1,142,888.60	
BROOKFIELD CORP	103,140	48.360	4,987,850.40	
ELEMENT FLEET MANAGEMENT COR	32,674	21.500	702,491.00	
IGM FINANCIAL INC	4,949	33.500	165,791.50	
NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	5,042	28.100	141,680.20	

	ONEX CORPORATION	4,217	93.180	392,940.06	
	TMX GROUP LTD	26,034	28.700	747,175.80	
	FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,745	1,229.350	2,145,215.75	
	GREAT-WEST LIFECO INC	22,964	43.050	988,600.20	
	IA FINANCIAL CORP INC	8,268	89.100	736,678.80	
	INTACT FINANCIAL CORP	12,446	208.890	2,599,844.94	
	MANULIFE FINANCIAL CORP	134,995	26.240	3,542,268.80	
	POWER CORP OF CANADA	41,436	37.330	1,546,805.88	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	41,957	68.380	2,869,019.66	
	CGI INC	15,720	137.050	2,154,426.00	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,480	3,215.720	4,759,265.60	
	DESCARTES SYSTEMS GRP/THE	6,424	109.880	705,869.12	
	OPEN TEXT CORP	21,507	55.330	1,189,982.31	
	SHOPIFY INC - CLASS A	88,905	99.720	8,865,606.60	
	BCE INC	5,509	53.120	292,638.08	
	QUEBECOR INC -CL B	14,578	29.730	433,403.94	
	ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	28,451	57.420	1,633,656.42	
	TELUS CORP	15,222	23.860	363,196.92	
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES	44,154	8.260	364,712.04	
	ALTAGAS LTD	27,309	27.040	738,435.36	
	BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	11,200	36.120	404,544.00	
	CANADIAN UTILITIES LTD-A	7,344	30.200	221,788.80	
	EMERA INC	22,591	47.500	1,073,072.50	
	FORTIS INC	35,086	54.360	1,907,274.96	
	HYDRO ONE LTD	24,747	37.540	929,002.38	
	NORTHLAND POWER INC	15,741	21.880	344,413.08	
	FIRSTSERVICE CORP	3,669	212.270	778,818.63	
	カナダ・ドル小計	3,035,135		182,214,346.98 (19,717,414,487)	
オーストラ リア・ドル	AMPOL LTD	19,016	34.150	649,396.40	
	SANTOS LTD	239,685	6.940	1,663,413.90	
	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	141,315	31.000	4,380,765.00	
	BHP GROUP LTD	376,828	46.190	17,405,685.32	
	BLUESCOPE STEEL LTD	37,214	20.310	755,816.34	
	FORTESCUE LTD	121,817	24.780	3,018,625.26	
	IGO LTD	54,323	8.530	463,375.19	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES-CD1	33,723	47.550	1,603,528.65	
	MINERAL RESOURCES LTD	11,662	61.230	714,064.26	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	92,960	12.670	1,177,803.20	
	ORICA LTD	36,212	15.470	560,199.64	
	PILBARA MINERALS LTD	197,160	3.560	701,889.60	
	RIO TINTO LTD	29,368	124.580	3,658,665.44	
	SOUTH32 LTD	336,639	3.060	1,030,115.34	
	REECE LTD	13,059	18.840	246,031.56	

BRAMBLES LTD	105,161	13.060	1,373,402.66	
COMPUTERSHARE LTD	38,485	23.280	895,930.80	
AURIZON HOLDINGS LTD	130,251	3.550	462,391.05	
QANTAS AIRWAYS LTD	78,226	5.200	406,775.20	
ARISTOCRAT LEISURE LTD	45,243	40.300	1,823,292.90	
IDP EDUCATION LTD	15,855	22.890	362,920.95	
LOTTERY CORP LTD/THE	173,268	4.560	790,102.08	
WESFARMERS LTD	83,000	52.720	4,375,760.00	
COLES GROUP LTD	99,972	15.200	1,519,574.40	
ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	138,738	4.890	678,428.82	
WOOLWORTHS GROUP LTD	88,246	34.280	3,025,072.88	
TREASURY WINE ESTATES LTD	45,684	10.620	485,164.08	
COCHLEAR LTD	5,404	267.000	1,442,868.00	
RAMSAY HEALTH CARE LTD	14,565	49.000	713,685.00	
SONIC HEALTHCARE LTD	31,126	28.910	899,852.66	
CSL LTD	35,557	262.200	9,323,045.40	
ANZ GROUP HOLDINGS LTD	224,517	24.180	5,428,821.06	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	124,266	103.330	12,840,405.78	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	237,426	28.100	6,671,670.60	
WESTPAC BANKING CORP	254,756	21.150	5,388,089.40	
ASX LTD	15,385	58.080	893,560.80	
MACQUARIE GROUP LTD	28,015	165.580	4,638,723.70	
WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	22,786	33.500	763,331.00	
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	173,755	5.760	1,000,828.80	
MEDIBANK PRIVATE LTD	193,702	3.420	662,460.84	
QBE INSURANCE GROUP LTD	124,450	15.170	1,887,906.50	
SUNCORP GROUP LTD	88,234	13.630	1,202,629.42	
WISETECH GLOBAL LTD	10,621	66.000	700,986.00	
XERO LTD	11,173	102.080	1,140,539.84	
TELSTRA GROUP LTD	273,343	3.780	1,033,236.54	
ORIGIN ENERGY LTD	134,865	8.400	1,132,866.00	
REA GROUP LTD	3,813	158.440	604,131.72	
SEEK LTD	29,833	23.380	697,495.54	
オーストラリア・ドル小計	4,820,702		113,295,325.52 (11,040,629,472)	
香港・ドル				
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	196,924	39.150	7,709,574.60	
TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	101,000	79.950	8,074,950.00	
XINYI GLASS HOLDINGS LTD	94,000	8.890	835,660.00	
MTR CORP	118,500	28.100	3,329,850.00	
SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	160,000	12.240	1,958,400.00	
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	176,000	40.250	7,084,000.00	
SANDS CHINA LTD	172,800	19.040	3,290,112.00	
BUDWEISER BREWING CO APAC LT	147,000	13.620	2,002,140.00	
WH GROUP LTD	561,000	4.910	2,754,510.00	



	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	247,000	21.050	5,199,350.00	
	HANG SENG BANK LTD	63,400	87.500	5,547,500.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	88,000	279.600	24,604,800.00	
	AIA GROUP LTD	868,200	69.200	60,079,440.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	41,000	38.100	1,562,100.00	
	CLP HOLDINGS LTD	119,600	60.400	7,223,840.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	861,389	5.300	4,565,361.70	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	91,500	39.850	3,646,275.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	160,924	38.150	6,139,250.60	
	ESR GROUP LTD	157,000	10.000	1,570,000.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	190,000	10.600	2,014,000.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	83,384	21.250	1,771,910.00	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	84,833	11.720	994,242.76	
	SINO LAND CO	248,200	7.770	1,928,514.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	108,000	76.400	8,251,200.00	
	SWIRE PACIFIC LTD - CL A	27,000	51.000	1,377,000.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	116,800	15.200	1,775,360.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	125,000	24.950	3,118,750.00	
	香港・ドル小計	5,408,454		178,408,090.66 (3,361,208,428)	
シンガポール・ドル	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	10,800	29.000	313,200.00	
	KEPPEL CORP LTD	94,400	6.430	606,992.00	
	SEATRUM LTD	3,231,727	0.107	345,794.78	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	108,600	3.720	403,992.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	113,566	6.370	723,415.42	
	GENTING SINGAPORE LTD	452,500	0.910	411,775.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	159,600	3.680	587,328.00	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	130,900	31.760	4,157,384.00	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	258,400	12.690	3,279,096.00	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	93,500	27.320	2,554,420.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	65,200	9.560	623,312.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	579,015	2.290	1,325,944.35	
	SEBACORP INDUSTRIES LTD	89,200	5.160	460,272.00	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	220,100	3.060	673,506.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	49,000	6.230	305,270.00	
UOL GROUP LTD	30,900	5.940	183,546.00		
	シンガポール・ドル小計	5,687,408		16,955,247.55 (1,871,520,226)	
ニュージーランド・ドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	90,913	7.900	718,212.70	
	EBOS GROUP LTD	12,972	36.990	479,834.28	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	45,732	23.800	1,088,421.60	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	132,027	5.070	669,376.89	
	MERCURY NZ LTD	48,206	6.080	293,092.48	
	MERIDIAN ENERGY LTD	91,327	5.130	468,507.51	
	ニュージーランド・ドル小計	421,177		3,717,445.46	

				(337,172,303)	
イギリス・ ポンド	BP PLC	1,284,625	4.719	6,062,145.37	
	SHELL PLC	508,042	25.535	12,972,852.47	
	ANGLO AMERICAN PLC	95,436	21.385	2,040,898.86	
	ANTOFAGASTA PLC	30,983	14.185	439,493.85	
	CRH PLC	54,581	49.230	2,687,022.63	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	10,296	44.500	458,172.00	
	ENDEAVOUR MINING PLC	17,507	18.340	321,078.38	
	GLENCORE PLC	773,648	4.439	3,434,223.47	
	JOHNSON MATTHEY PLC	19,637	16.065	315,468.40	
	MONDI PLC	33,905	14.000	474,670.00	
	RIO TINTO PLC	83,083	54.000	4,486,482.00	
	ASHTED GROUP PLC	30,439	47.340	1,440,982.26	
	BAE SYSTEMS PLC	231,522	10.350	2,396,252.70	
	BUNZL PLC	22,658	29.430	666,824.94	
	DCC PLC	5,954	53.620	319,253.48	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	119,456	5.230	624,754.88	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	649,146	2.634	1,709,850.56	
	SMITHS GROUP PLC	24,369	16.365	398,798.68	
	SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	5,904	91.760	541,751.04	
	EXPERIAN PLC	69,750	29.180	2,035,305.00	
	INTERTEK GROUP PLC	11,884	39.840	473,458.56	
	RELX PLC	144,062	30.460	4,388,128.52	
	RENTOKIL INITIAL PLC	190,467	4.346	827,769.58	
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	64,766	5.082	329,140.81	
	BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	6,637	46.460	308,355.02	
	BURBERRY GROUP PLC	26,233	14.500	380,378.50	
	PERSIMMON PLC	27,665	12.590	348,302.35	
	TAYLOR WIMPEY PLC	225,588	1.291	291,234.10	
	COMPASS GROUP PLC	127,518	20.170	2,572,038.06	
	ENTAIN PLC	42,158	8.002	337,348.31	
	INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	11,820	61.160	722,911.20	
	PEARSON PLC	46,942	9.274	435,340.10	
	WHITBREAD PLC	16,522	31.100	513,834.20	
	JD SPORTS FASHION PLC	251,482	1.573	395,581.18	
KINGFISHER PLC	179,593	2.201	395,284.19		
NEXT PLC	9,030	79.300	716,079.00		
OCADO GROUP PLC	42,697	5.936	253,449.39		
SAINSBURY (J) PLC	113,480	2.835	321,715.80		
TESCO PLC	551,571	2.844	1,568,667.92		
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	24,258	23.880	579,281.04		
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	157,793	25.145	3,967,704.98		
COCA-COLA HBC AG-DI	17,866	21.790	389,300.14		
DIAGEO PLC	169,199	27.400	4,636,052.60		

IMPERIAL BRANDS PLC	59,422	18.345	1,090,096.59		
HALEON PLC	415,231	3.311	1,374,829.84		
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	53,559	53.900	2,886,830.10		
UNILEVER PLC	190,822	37.535	7,162,503.77		
NMC HEALTH PLC	3,940	0.010	39.40		
SMITH & NEPHEW PLC	57,278	10.215	585,094.77		
ASTRAZENECA PLC	115,098	100.320	11,546,631.36		
GSK PLC	311,133	14.010	4,358,973.33		
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	14,590	17.225	251,312.75		
BARCLAYS PLC	1,208,742	1.403	1,695,865.02		
HSBC HOLDINGS PLC	1,465,067	5.948	8,714,218.51		
LLOYDS BANKING GROUP PLC	4,801,858	0.434	2,084,006.37		
NATWEST GROUP PLC	407,238	2.064	840,539.23		
STANDARD CHARTERED PLC	182,397	6.404	1,168,070.38		
3I GROUP PLC	70,572	22.310	1,574,461.32		
ABRDN PLC	138,015	1.672	230,761.08		
HARGREAVES LANSDOWN PLC	31,008	7.104	220,280.83		
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	30,487	89.100	2,716,391.70		
M&G PLC	119,733	2.104	251,918.23		
SCHRODERS PLC	61,711	4.010	247,461.11		
ST JAMES'S PLACE PLC	33,823	6.474	218,970.10		
WISE PLC - A	43,661	7.812	341,079.73		
ADMIRAL GROUP PLC	19,808	27.030	535,410.24		
AVIVA PLC	217,835	4.156	905,322.26		
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	457,083	2.285	1,044,434.65		
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	59,286	4.637	274,909.18		
PRUDENTIAL PLC	211,966	8.542	1,810,613.57		
SAGE GROUP PLC/THE	75,045	11.300	848,008.50		
HALMA PLC	32,277	21.240	685,563.48		
BT GROUP PLC	540,623	1.225	662,263.17		
VODAFONE GROUP PLC	1,629,376	0.708	1,153,598.20		
CENTRICA PLC	403,810	1.474	595,215.94		
NATIONAL GRID PLC	280,606	10.255	2,877,614.53		
SEVERN TRENT PLC	20,117	27.160	546,377.72		
SSE PLC	78,838	18.305	1,443,129.59		
UNITED UTILITIES GROUP PLC	51,208	11.250	576,090.00		
AUTO TRADER GROUP PLC	77,901	7.182	559,484.98		
INFORMA PLC	102,755	7.380	758,331.90		
WPP PLC	78,503	7.030	551,876.09		
イギリス・ボンド小計	20,682,594		134,366,216.04 (25,104,983,805)		
イスラエル・シュケル	ICL GROUP LTD	67,143	19.430	1,304,588.49	
	ELBIT SYSTEMS LTD	1,389	759.100	1,054,389.90	
	BANK HAPOALIM BM	98,327	32.000	3,146,464.00	

	BANK LEUMI LE-ISRAEL	115,937	28.800	3,338,985.60	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	85,339	18.530	1,581,331.67	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	11,916	136.400	1,625,342.40	
	NICE LTD	3,919	717.800	2,813,058.20	
	AZRIELI GROUP LTD	3,527	221.700	781,935.90	
	イスラエル・シュケル小計	387,497		15,646,096.16 (624,488,894)	
スイス・フ ラン	CLARIANT AG-REG	10,101	13.070	132,020.07	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	538	614.500	330,601.00	
	GIVAUDAN-REG	680	3,245.000	2,206,600.00	
	HOLCIM LTD	39,459	63.900	2,521,430.10	
	SIG GROUP AG	22,269	20.260	451,169.94	
	SIKA AG-REG	11,005	236.800	2,605,984.00	
	ABB LTD-REG	119,421	34.090	4,071,061.89	
	GEBERIT AG-REG	2,322	486.400	1,129,420.80	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	1,766	186.600	329,535.60	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	3,030	196.150	594,334.50	
	VAT GROUP AG	2,164	389.000	841,796.00	
	ADECCO GROUP AG-REG	14,810	42.020	622,316.20	
	SGS SA-REG	11,450	74.480	852,796.00	
	KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	4,194	256.200	1,074,502.80	
	CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	39,172	109.500	4,289,334.00	
	SWATCH GROUP AG/THE-BR	1,716	229.800	394,336.80	
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	5,225	43.850	229,116.25	
	AVOLTA AG	8,656	30.870	267,210.72	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	216	1,453.000	313,848.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	72	10,880.000	783,360.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	8	107,400.000	859,200.00	
	NESTLE SA-REG	200,093	99.130	19,835,219.09	
	ALCON INC	35,956	65.420	2,352,241.52	
	SONOVA HOLDING AG-REG	4,173	251.800	1,050,761.40	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	8,823	122.000	1,076,406.00	
	BACHEM HOLDING AG	1,756	65.800	115,544.80	
	LONZA GROUP AG-REG	5,801	341.800	1,982,781.80	
	NOVARTIS AG-REG	154,681	84.840	13,123,136.04	
	ROCHE HOLDING AG-BR	2,584	249.200	643,932.80	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	52,244	236.400	12,350,481.60	
	SANDOZ GROUP AG	30,936	25.980	803,717.28	
	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	3,006	106.100	318,936.60	
JULIUS BAER GROUP LTD	15,168	43.400	658,291.20		
PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,585	1,144.000	1,813,240.00		
UBS GROUP AG-REG	248,248	23.900	5,933,127.20		
BALOISE HOLDING AG - REG	3,909	129.800	507,388.20		
HELVETIA HOLDING AG-REG	2,221	118.100	262,300.10		

	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	2,272	561.000	1,274,592.00	
	SWISS RE AG	22,781	102.750	2,340,747.75	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	11,172	435.500	4,865,406.00	
	TEMENOS AG - REG	3,743	72.920	272,939.56	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	13,555	75.060	1,017,438.30	
	SWISSCOM AG-REG	1,994	511.400	1,019,731.60	
	BKW AG	1,385	150.900	208,996.50	
	SWISS PRIME SITE-REG	5,572	87.300	486,435.60	
	スイス・フラン小計	1,131,932		99,213,767.61 (16,723,472,668)	
デンマーク・クローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	7,211	534.600	3,855,000.60	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	15,785	349.500	5,516,857.50	
	ROCKWOOL A/S-B SHS	513	1,825.000	936,225.00	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	78,424	182.540	14,315,516.96	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-A	206	10,710.000	2,206,260.00	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-B	412	10,870.000	4,478,440.00	
	DSV A/S	13,716	1,053.500	14,449,806.00	
	PANDORA A/S	5,888	911.400	5,366,323.20	
	CARLSBERG AS-B	8,080	827.400	6,685,392.00	
	COLOPLAST-B	8,316	803.200	6,679,411.20	
	DEMANT A/S	8,178	290.700	2,377,344.60	
	GENMAB A/S	4,634	2,142.000	9,926,028.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	245,570	689.400	169,295,958.00	
	DANSKE BANK A/S	50,000	175.850	8,792,500.00	
TRYG A/S	24,975	145.950	3,645,101.25		
ORSTED A/S	14,988	316.000	4,736,208.00		
	デンマーク・クローネ小計	486,896		263,262,372.31 (5,702,262,984)	
ノルウェー・クローネ	AKER BP ASA	21,204	304.600	6,458,738.40	
	EQUINOR ASA	72,237	342.250	24,723,113.25	
	NORSK HYDRO ASA	108,109	63.060	6,817,353.54	
	YARA INTERNATIONAL ASA	12,718	361.900	4,602,644.20	
	KONGSBERG GRUPPEN ASA	6,526	464.600	3,031,979.60	
	MOWI ASA	30,723	192.250	5,906,496.75	
	ORKLA ASA	63,195	79.920	5,050,544.40	
	SALMAR ASA	4,188	584.600	2,448,304.80	
	DNB BANK ASA	66,810	204.800	13,682,688.00	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	18,691	182.000	3,401,762.00	
	TELENOR ASA	48,435	115.650	5,601,507.75	
ADEVINTA ASA	15,540	111.400	1,731,156.00		
	ノルウェー・クローネ小計	468,376		83,456,288.69 (1,152,531,347)	
スウェーデン・クローナ	BOLIDEN AB	20,658	284.350	5,874,102.30	
	HOLMEN AB-B SHARES	7,024	440.600	3,094,774.40	
	SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B	52,203	159.400	8,321,158.20	

ALFA LAVAL AB	23,093	389.800	9,001,651.40	
ASSA ABLOY AB-B	72,539	269.600	19,556,514.40	
ATLAS COPCO AB-A SHS	200,121	161.750	32,369,571.75	
ATLAS COPCO AB-B SHS	125,066	138.650	17,340,400.90	
BEIJER REF AB	23,918	117.100	2,800,797.80	
EPIROC AB-A	44,746	194.000	8,680,724.00	
EPIROC AB-B	33,182	164.900	5,471,711.80	
HUSQVARNA AB-B SHS	34,897	80.300	2,802,229.10	
INDUTRADE AB	17,913	230.300	4,125,363.90	
INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	8,223	232.900	1,915,136.70	
LIFCO AB-B SHS	15,149	229.200	3,472,150.80	
NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	109,274	62.580	6,838,366.92	
SAAB AB-B	6,953	547.600	3,807,462.80	
SANDVIK AB	76,866	204.400	15,711,410.40	
SKANSKA AB-B SHS	26,915	168.200	4,527,103.00	
SKF AB-B SHARES	31,715	195.500	6,200,282.50	
VOLVO AB-A SHS	13,283	245.400	3,259,648.20	
VOLVO AB-B SHS	111,479	242.200	27,000,213.80	
SECURITAS AB-B SHS	41,010	92.840	3,807,368.40	
VOLVO CAR AB-B	38,628	34.380	1,328,030.64	
EVOLUTION AB	13,101	1,101.800	14,434,681.80	
HENNES & MAURITZ AB-B SHS	52,210	175.040	9,138,838.40	
ESSITY AKTIEBOLAG-B	45,427	263.400	11,965,471.80	
GETINGE AB-B SHS	13,151	225.900	2,970,810.90	
SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	13,513	252.400	3,410,681.20	
NORDEA BANK ABP	248,187	116.900	29,013,060.30	
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	129,315	126.800	16,397,142.00	
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	113,533	99.240	11,267,014.92	
SWEDBANK AB - A SHARES	63,538	193.250	12,278,718.50	
EQT AB	23,194	248.800	5,770,667.20	
INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	7,211	314.900	2,270,743.90	
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	10,642	314.700	3,349,037.40	
INVESTOR AB-B SHS	131,535	215.500	28,345,792.50	
LUNDBERGS AB-B SHS	6,081	498.100	3,028,946.10	
ERICSSON LM-B SHS	221,040	52.580	11,622,283.20	
HEXAGON AB-B SHS	157,105	104.500	16,417,472.50	
TELE2 AB-B SHS	38,424	81.900	3,146,925.60	
TELIA CO AB	187,675	24.920	4,676,861.00	
FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	31,938	62.820	2,006,345.16	
SAGAX AB-B	14,721	239.300	3,522,735.30	
スウェーデン・クローナ小計	2,656,396		392,340,403.79 (5,575,157,138)	
ユーロ				
ENI SPA	167,120	15.108	2,524,848.96	
GALP ENERGIA SGPS SA	31,670	13.620	431,345.40	

NESTE OYJ	31,509	34.200	1,077,607.80	
OMV AG	10,043	39.370	395,392.91	
REPSOL SA	96,457	14.025	1,352,809.42	
TENARIS SA	41,201	15.335	631,817.33	
TOTALENERGIES SE	169,457	61.680	10,452,107.76	
AIR LIQUIDE SA	39,911	173.760	6,934,935.36	
AKZO NOBEL N.V.	12,475	70.180	875,495.50	
ARCELORMITTAL	33,606	22.830	767,224.98	
ARKEMA	5,145	93.520	481,160.40	
BASF SE	64,323	42.975	2,764,280.92	
COVESTRO AG	16,049	48.600	779,981.40	
DSM-FIRMENICH AG	13,915	87.170	1,212,970.55	
EVONIK INDUSTRIES AG	17,669	17.410	307,617.29	
HEIDELBERG MATERIALS AG	10,008	74.100	741,592.80	
OCI NV	6,000	20.950	125,700.00	
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	20,828	33.150	690,448.20	
SOLVAY SA	4,802	105.450	506,370.90	
STORA ENSO OYJ-R SHS	39,228	11.985	470,147.58	
SYMRISE AG	9,721	101.400	985,709.40	
UMICORE	16,912	24.430	413,160.16	
UPM-KYMMENE OYJ	38,447	32.000	1,230,304.00	
VOESTALPINE AG	10,410	26.040	271,076.40	
WACKER CHEMIE AG	1,414	112.900	159,640.60	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	14,086	36.760	517,801.36	
AIRBUS SE	43,824	135.560	5,940,781.44	
ALSTOM	25,574	11.495	293,973.13	
BOUYGUES SA	17,123	35.140	601,702.22	
BRENNTAG SE	12,153	77.260	938,940.78	
CNH INDUSTRIAL NV	82,028	9.690	794,851.32	
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	34,454	59.420	2,047,256.68	
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	35,066	29.830	1,046,018.78	
DASSAULT AVIATION SA	1,720	185.000	318,200.00	
EIFFAGE	6,641	92.760	616,019.16	
FERROVIAL SE	38,869	31.540	1,225,928.26	
GEA GROUP AG	10,467	33.700	352,737.90	
IMCD NV	4,340	137.400	596,316.00	
KINGSPAN GROUP PLC	11,262	71.300	802,980.60	
KNORR-BREMSE AG	7,217	57.860	417,575.62	
KONE OYJ-B	24,225	40.760	987,411.00	
LEGRAND SA	19,539	88.160	1,722,558.24	
METSO CORP	50,483	9.102	459,496.26	
MTU AERO ENGINES AG	3,854	187.850	723,973.90	
PRYSMIAN SPA	19,681	35.270	694,148.87	
RATIONAL AG	350	590.000	206,500.00	

RHEINMETALL AG	2,899	275.200	797,804.80	
SAFRAN SA	25,961	160.140	4,157,394.54	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	41,472	167.200	6,934,118.40	
SIEMENS AG-REG	56,806	152.880	8,684,501.28	
SIEMENS ENERGY AG	40,928	10.765	440,589.92	
THALES SA	7,074	138.650	980,810.10	
VINCI SA	38,750	112.120	4,344,650.00	
WARTSILA OYJ ABP	38,260	12.700	485,902.00	
BUREAU VERITAS SA	17,817	22.470	400,347.99	
RANDSTAD NV	8,946	54.880	490,956.48	
TELEPERFORMANCE	4,299	130.300	560,159.70	
WOLTERS KLUWER	18,802	125.950	2,368,111.90	
ADP	1,346	113.000	152,098.00	
AENA SME SA	5,640	156.500	882,660.00	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	50,885	8.020	408,097.70	
DHL GROUP	73,067	42.910	3,135,304.97	
GETLINK SE	30,428	16.745	509,516.86	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	23,310	96.070	2,239,391.70	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	3,679	87.250	320,992.75	
CONTINENTAL AG	8,078	71.600	578,384.80	
DR ING HC F PORSCHE AG	8,498	84.880	721,310.24	
FERRARI NV	8,992	335.400	3,015,916.80	
MERCEDES-BENZ GROUP AG	61,762	59.290	3,661,868.98	
MICHELIN (CGDE)	51,844	30.840	1,598,868.96	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	10,089	45.210	456,123.69	
RENAULT SA	14,764	35.825	528,920.30	
STELLANTIS NV	171,748	19.714	3,385,840.07	
VALEO	14,444	13.535	195,499.54	
VOLKSWAGEN AG	1,960	119.450	234,122.00	
VOLKSWAGEN AG-PREF	15,275	106.880	1,632,592.00	
ADIDAS AG	12,090	192.720	2,329,984.80	
HERMES INTERNATIONAL	2,402	1,897.000	4,556,594.00	
KERING	5,801	391.000	2,268,191.00	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	20,510	690.500	14,162,155.00	
MONCLER SPA	15,710	51.020	801,524.20	
PUMA SE	9,601	58.480	561,466.48	
SEB SA	1,127	104.600	117,884.20	
ACCOR SA	16,469	31.630	520,914.47	
AMADEUS IT GROUP SA	32,915	63.820	2,100,635.30	
DELIVERY HERO SE	13,293	30.425	404,439.52	
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	13,239	143.750	1,903,106.25	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	5,785	33.120	191,599.20	
SODEXO SA	6,960	99.340	691,406.40	
D'IETEREN GROUP	1,885	157.000	295,945.00	



INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	81,748	37.540	3,068,819.92	
PROSUS NV	114,557	30.075	3,445,301.77	
ZALANDO SE	17,418	22.080	384,589.44	
CARREFOUR SA	49,914	17.355	866,257.47	
HELLOFRESH SE	9,790	14.420	141,171.80	
JERONIMO MARTINS	22,106	22.520	497,827.12	
KESKO OYJ-B SHS	20,250	17.485	354,071.25	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	71,069	26.340	1,871,957.46	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	66,143	57.180	3,782,056.74	
DANONE	50,315	59.150	2,976,132.25	
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	35,407	9.936	351,803.95	
HEINEKEN HOLDING NV	7,962	70.550	561,719.10	
HEINEKEN NV	22,805	82.720	1,886,429.60	
JDE PEET'S NV	13,317	24.420	325,201.14	
KERRY GROUP PLC-A	12,402	73.780	915,019.56	
LOTUS BAKERIES	31	7,980.000	247,380.00	
PERNOD RICARD SA	14,736	155.750	2,295,132.00	
REMY COINTREAU	2,008	108.550	217,968.40	
BEIERSDORF AG	6,813	129.150	879,898.95	
HENKEL AG & CO KGAA	8,714	62.700	546,367.80	
HENKEL AG & CO KGAA VOR-PREF	13,009	71.380	928,582.42	
L'OREAL	17,738	431.850	7,660,155.30	
AMPLIFON SPA	10,123	28.240	285,873.52	
BIOMERIEUX	2,791	98.840	275,862.44	
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	3,583	83.980	300,900.34	
DIASORIN SPA	1,313	86.160	113,128.08	
ESSILORLUXOTTICA	21,958	177.240	3,891,835.92	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	17,125	37.280	638,420.00	
FRESENIUS SE & CO KGAA	31,227	28.570	892,155.39	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	68,092	18.828	1,282,036.17	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	19,203	52.420	1,006,621.26	
ARGENX SE	4,159	402.200	1,672,749.80	
BAYER AG-REG	75,808	30.670	2,325,031.36	
EUROFINS SCIENTIFIC	9,270	52.820	489,641.40	
GRIFOLS SA	15,169	12.660	192,039.54	
IPSEN	3,380	102.900	347,802.00	
MERCK KGAA	8,996	160.400	1,442,958.40	
ORION OYJ-CLASS B	10,542	36.500	384,783.00	
QIAGEN N.V.	15,665	37.630	589,473.95	
RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA	8,068	44.320	357,573.76	
SANOFI	86,255	84.870	7,320,461.85	
SARTORIUS AG-VORZUG	2,164	294.500	637,298.00	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	2,207	207.500	457,952.50	
UCB SA	10,230	67.300	688,479.00	

ABN AMRO BANK NV-CVA	28,787	12.525	360,557.17	
AIB GROUP PLC	90,921	4.148	377,140.30	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	452,595	8.696	3,935,766.12	
BANCO SANTANDER SA	1,229,919	3.798	4,671,232.36	
BANK OF IRELAND GROUP PLC	75,242	8.574	645,124.90	
BNP PARIBAS	80,474	56.920	4,580,580.08	
CAIXABANK SA	308,048	4.197	1,292,877.45	
COMMERZBANK AG	73,561	11.305	831,607.10	
CREDIT AGRICOLE SA	90,899	11.800	1,072,608.20	
ERSTE GROUP BANK AG	25,105	36.730	922,106.65	
FINECOBANK SPA	43,093	12.235	527,242.85	
ING GROEP NV	270,646	12.768	3,455,608.12	
INTESA SANPAOLO	1,163,000	2.646	3,077,298.00	
KBC GROUP NV	17,643	52.480	925,904.64	
MEDIOBANCA SPA	47,708	10.730	511,906.84	
SOCIETE GENERALE SA	55,196	22.740	1,255,157.04	
UNICREDIT SPA	141,513	25.325	3,583,816.72	
ADYEN NV	1,553	1,087.800	1,689,353.40	
AMUNDI SA	3,955	56.100	221,875.50	
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	146,020	11.272	1,645,937.44	
DEUTSCHE BOERSE AG	14,432	174.050	2,511,889.60	
EDENRED	20,297	50.020	1,015,255.94	
EURAZEO SE	1,792	62.750	112,448.00	
EURONEXT NV	5,502	76.100	418,702.20	
EXOR NV	8,669	88.400	766,339.60	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT NV	7,933	72.300	573,555.90	
NEXI SPA	57,060	7.102	405,240.12	
SOFINA	804	202.600	162,890.40	
WENDEL	2,547	78.500	199,939.50	
WORLDLINE SA	16,677	13.950	232,644.15	
AEGON LTD	127,748	4.942	631,330.61	
AGEAS	11,247	39.410	443,244.27	
ALLIANZ SE-REG	29,598	231.000	6,837,138.00	
ASR NEDERLAND NV	14,593	37.420	546,070.06	
ASSICURAZIONI GENERALI	72,382	18.970	1,373,086.54	
AXA SA	132,535	28.440	3,769,295.40	
HANNOVER RUECK SE	4,298	217.500	934,815.00	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	10,609	387.500	4,110,987.50	
NN GROUP NV	16,917	31.750	537,114.75	
POSTE ITALIANE SPA	34,720	9.814	340,742.08	
SAMPO OYJ-A SHS	36,423	39.315	1,431,970.24	
TALANX AG	5,345	65.700	351,166.50	
BECHTLE AG	4,305	45.770	197,039.85	
CAPGEMINI SE	12,750	188.550	2,404,012.50	

DASSAULT SYSTEMES SE	50,781	43.125	2,189,930.62	
NEMETSCHEK SE	5,941	81.040	481,458.64	
SAP SE	78,890	144.540	11,402,760.60	
NOKIA OYJ	404,925	3.247	1,314,791.47	
ASM INTERNATIONAL NV	3,170	469.400	1,487,998.00	
ASML HOLDING NV	30,212	629.200	19,009,390.40	
BE SEMICONDUCTOR INDUSTRIES	6,286	128.550	808,065.30	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	97,120	35.700	3,467,184.00	
STMICROELECTRONICS NV	48,663	43.035	2,094,212.20	
CELLNEX TELECOM SA	41,167	35.100	1,444,961.70	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	245,684	21.935	5,389,078.54	
ELISA OYJ	10,160	41.240	418,998.40	
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	28,190	11.300	318,547.00	
KONINKLIJKE KPN NV	222,179	3.170	704,307.43	
ORANGE	132,722	11.258	1,494,184.27	
TELECOM ITALIA SPA	696,355	0.263	183,141.36	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	79,654	2.350	187,186.90	
TELEFONICA SA	412,202	3.888	1,602,641.37	
ACCIONA SA	1,810	128.800	233,128.00	
CORP ACCIONA ENERGIAS RENOVA	6,849	26.740	183,142.26	
E.ON SE	164,322	11.975	1,967,755.95	
EDP RENOVAVEIS SA	27,294	16.345	446,120.43	
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	227,046	4.404	999,910.58	
ELIA GROUP SA/NV	2,111	98.500	207,933.50	
ENAGAS SA	14,471	16.745	242,316.89	
ENDESA SA	25,535	19.100	487,718.50	
ENEL SPA	617,940	6.433	3,975,208.02	
ENGIE	142,233	15.872	2,257,522.17	
FORTUM OYJ	30,500	12.960	395,280.00	
IBERDROLA SA	449,851	11.305	5,085,565.55	
NATURGY ENERGY GROUP SA	10,603	27.200	288,401.60	
REDEIA CORP SA	34,539	15.330	529,482.87	
RWE AG	48,289	39.260	1,895,826.14	
SNAM SPA	133,867	4.559	610,299.65	
TERNA-RETE ELETTRICA NAZIONA	101,686	7.408	753,289.88	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	48,732	28.680	1,397,633.76	
VERBUND AG	5,338	84.700	452,128.60	
BOLLORE SE	69,288	5.340	369,997.92	
PUBLICIS GROUPE	15,558	77.280	1,202,322.24	
SCOUT24 SE	4,671	63.320	295,767.72	
UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	66,170	24.190	1,600,652.30	
VIVENDI SE	57,161	8.754	500,387.39	
LEG IMMOBILIEN SE	6,505	71.900	467,709.50	
VONOVIA SE	52,313	25.950	1,357,522.35	

ユーロ小計	13,426,510		350,987,022.51 (56,687,914,006)	
合計	84,138,056		582,354,704,334 (582,354,704,334)	

(注)金額欄の( )内は、外貨建保有証券にかかるものの内書きであり、また邦貨換算金額で表示しております。

通貨	銘柄数		組入株式時価比率	合計金額に対する比率
アメリカ・ドル	株式	603銘柄	71.5%	74.6%
カナダ・ドル	株式	86銘柄	3.2%	3.4%
オーストラリア・ドル	株式	48銘柄	1.8%	1.9%
香港・ドル	株式	27銘柄	0.6%	0.6%
シンガポール・ドル	株式	16銘柄	0.3%	0.3%
ニュージーランド・ドル	株式	6銘柄	0.1%	0.1%
イギリス・ポンド	株式	82銘柄	4.1%	4.3%
イスラエル・シケル	株式	8銘柄	0.1%	0.1%
スイス・フラン	株式	45銘柄	2.8%	2.9%
デンマーク・クローネ	株式	16銘柄	0.9%	1.0%
ノルウェー・クローネ	株式	12銘柄	0.2%	0.2%
スウェーデン・クローナ	株式	43銘柄	0.9%	1.0%
ユーロ	株式	222銘柄	9.3%	9.7%

(b)株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	アメリカ・ドル	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	13,343.00	1,454,520.43	
		AMERICAN HOMES 4 RENT- A	26,290.00	940,919.10	
		AMERICAN TOWER CORP	34,996.00	7,215,475.28	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	35,166.00	636,504.60	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	10,245.00	1,750,153.35	
		BOSTON PROPERTIES INC	9,604.00	547,428.00	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	7,861.00	705,524.75	
		CROWN CASTLE INC	33,131.00	3,842,533.38	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	22,476.00	3,106,183.20	
		EQUINIX INC	6,935.00	5,605,629.85	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	14,256.00	999,203.04	
		EQUITY RESIDENTIAL	26,128.00	1,478,322.24	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	4,379.00	929,355.17	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	15,328.00	1,985,435.84	
		GAMING AND LEISURE PROPERTIE	17,613.00	808,084.44	
		HEALTHCARE REALTY TRUST INC	22,843.00	345,614.59	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	36,377.00	623,501.78	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	59,277.00	1,033,790.88	
		INVITATION HOMES INC	44,730.00	1,474,300.80	
		IRON MOUNTAIN INC	23,774.00	1,504,418.72	
KIMCO REALTY CORP	44,824.00	852,552.48			

	MID-AMERICA APARTMENT COMM	9,567.00	1,184,968.62	
	PROLOGIS INC	69,206.00	7,823,046.24	
	PUBLIC STORAGE	11,880.00	3,063,852.00	
	REALTY INCOME CORP	49,884.00	2,677,274.28	
	REGENCY CENTERS CORP	13,101.00	805,318.47	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	8,176.00	2,004,755.20	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	24,260.00	2,978,157.60	
	SUN COMMUNITIES INC	10,118.00	1,295,104.00	
	UDR INC	20,610.00	686,106.90	
	VENTAS INC	28,342.00	1,287,010.22	
	VICI PROPERTIES INC	76,652.00	2,270,432.24	
	WELLTOWER INC	37,522.00	3,309,440.40	
	WEYERHAEUSER CO	54,126.00	1,715,794.20	
	WP CAREY INC	16,778.00	1,043,423.82	
	アメリカ・ドル小計	939,798.00	69,984,136.11 (10,292,566,898)	
カナダ・ドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	8,170.00	374,349.40	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	7,441.00	129,696.63	
	カナダ・ドル小計	15,611.00	504,046.03 (54,542,821)	
オーストラリア・ドル	APA GROUP	89,811.00	756,208.62	
	DEXUS/AU	79,604.00	557,228.00	
	GOODMAN GROUP	133,948.00	3,123,667.36	
	GPT GROUP	121,221.00	494,581.68	
	LENLEASE GROUP	63,652.00	424,558.84	
	MIRVAC GROUP	326,863.00	643,920.11	
	SCENTRE GROUP	350,311.00	921,317.93	
	STOCKLAND	193,824.00	788,863.68	
	TRANSURBAN GROUP	235,928.00	3,026,956.24	
	VICINITY CENTRES	241,241.00	437,852.41	
	オーストラリア・ドル小計	1,836,403.00	11,175,154.87 (1,089,018,842)	
香港・ドル	HKT TRUST AND HKT LTD-SS	276,000.00	2,318,400.00	
	LINK REIT	189,400.00	7,367,660.00	
	香港・ドル小計	465,400.00	9,686,060.00 (182,485,370)	
シンガポール・ドル	CAPITALAND ASCENDAS REIT	267,000.00	758,280.00	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMER	408,716.00	756,124.60	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	208,100.00	337,122.00	
	MAPLETREE PAN ASIA COM TRUST	112,400.00	153,988.00	
	シンガポール・ドル小計	996,216.00	2,005,514.60 (221,368,702)	
イギリス・ポンド	LAND SECURITIES GROUP PLC	59,857.00	376,261.10	
	SEGRO PLC	89,254.00	732,239.81	

	イギリス・ボンド小計	149,111.00	1,108,500.91 (207,112,310)	
ユーロ	COVIVIO	2,388.00	105,931.68	
	GECINA SA	3,082.00	311,898.40	
	KLEPIERRE	18,172.00	419,773.20	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	8,942.00	512,018.92	
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	13,418.00	342,427.36	
	ユーロ小計	46,002.00	1,692,049.56 (273,282,924)	
投資証券合計			12,320,377,867 (12,320,377,867)	
合 計			12,320,377,867 (12,320,377,867)	

(注) 金額欄の( )内は、外貨建有価証券にかかるものの内書きであり、また邦貨換算金額で表示しております。

通貨	銘柄数	組入 投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカ・ドル	投資証券 35銘柄	1.7%	83.5%
カナダ・ドル	投資証券 2銘柄	0.0%	0.4%
オーストラリア・ドル	投資証券 10銘柄	0.2%	8.8%
香港・ドル	投資証券 2銘柄	0.0%	1.5%
シンガポール・ドル	投資証券 4銘柄	0.0%	1.8%
イギリス・ボンド	投資証券 2銘柄	0.0%	1.7%
ユーロ	投資証券 5銘柄	0.0%	2.2%

#### デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

#### エマージング株式インデックス・マザーファンド

##### (1) 貸借対照表

(単位：円)

	(2022年11月30日現在)	(2023年11月30日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	3,890,895,302	1,901,750,219
金銭信託	31,231,738	4,844,447
コール・ローン	192,702,578	290,896,676
株式	18,551,125,070	30,124,797,843
投資信託受益証券	1,080,935,590	1,545,640,595
投資証券	1,751,546,641	2,721,233,072
派生商品評価勘定	150,967,660	31,447,803
未収入金	-	194,025
未収配当金	34,213,350	48,464,708
差入委託証拠金	977,033,005	813,606,188
流動資産合計	26,660,650,934	37,482,875,576
資産合計	26,660,650,934	37,482,875,576
負債の部		

流動負債		
派生商品評価勘定	83,196,904	4,352,904
未払解約金	26,843,066	422,831,305
その他未払費用	543	350
流動負債合計	110,040,513	427,184,559
負債合計	110,040,513	427,184,559
純資産の部		
元本等		
元本	16,108,126,428	20,155,110,227
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	10,442,483,993	16,900,580,790
元本等合計	26,550,610,421	37,055,691,017
純資産合計	26,550,610,421	37,055,691,017
負債純資産合計	26,660,650,934	37,482,875,576

## ( 2 ) 注記表

## ( 重要な会計方針の注記 )

項 目	自 2022年12月1日 至 2023年11月30日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式、投資信託受益証券、投資証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1) 先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場によっております。</p> <p>(2) 為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>
3. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	<p>外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。</p>

## ( 重要な会計上の見積りに関する注記 )

会計上の見積りについて、翌計算期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクがある項目を識別していないため、注記を省略しております。

## （貸借対照表に関する注記）

項 目	（2022年11月30日現在）	（2023年11月30日現在）
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	16,108,126,428口	20,155,110,227口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.6483円 （1万口当たりの純資産額16,483円）	1口当たり純資産額 1.8385円 （1万口当たりの純資産額18,385円）

## （金融商品に関する注記）

## ・金融商品の状況に関する事項

項 目	自 2022年12月1日 至 2023年11月30日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、株式、投資信託受益証券、投資証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 当計算期間については、先物取引、為替予約取引を行っております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>



<p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p>	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。なお、投資信託協会の流動性リスク管理規制に抵触する場合には、流動性リスクを管理する会議で審議の上、流動性リスクの管理責任者が対処方針を決定します。その後、決定した対処方針やその実施等について、リスク管理会議に報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>
--------------------------	--

・金融商品の時価等に関する事項

項目	(2023年11月30日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（株式、投資信託受益証券、投資証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。

(デリバティブ取引に関する注記)

(2022年11月30日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち 1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建				
	MSCI EMGMKT DEC22	5,203,165,884	-	5,271,112,198	67,946,314
	小計	5,203,165,884	-	5,271,112,198	67,946,314
合計		5,203,165,884	-	5,271,112,198	67,946,314

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち 1年超		
市場取引以外 の取引	為替予約取引 買建				
	アメリカ・ドル	262,300,000	-	262,124,442	175,558
	小計	262,300,000	-	262,124,442	175,558
合計		262,300,000	-	262,124,442	175,558

(2023年11月30日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち 1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建				
	MSCI EMGMKT DEC23	2,640,901,429	-	2,665,496,680	24,595,251
	小計	2,640,901,429	-	2,665,496,680	24,595,251
合計		2,640,901,429	-	2,665,496,680	24,595,251

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

1) 原則として計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しております。

このような時価が発表されていない場合には、計算期間末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

2) 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち 1年超		
市場取引以外 の取引	為替予約取引 買建				
	アメリカ・ドル	142,700,000	-	142,820,917	120,917
	小計	142,700,000	-	142,820,917	120,917
	売建				

	アメリカ・ドル	339,000,000	-	336,621,269	2,378,731
	小計	339,000,000	-	336,621,269	2,378,731
	合 計	481,700,000	-	479,442,186	2,499,648

## (注) 1. 時価の算定方法

為替予約取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

- 1) 計算期間末日に対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価していません。

計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

- ・ 計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、発表されている対顧客先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの対顧客先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。
- ・ 計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い受渡日として、発表されている対顧客先物相場の仲値を用いております。

- 2) 計算期間末日において対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については、計算期間末日の対顧客相場の仲値で評価しております。

- 3) 上記の算定方法にて、適正な時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。

## 2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

## (関連当事者との取引に関する注記)

自 2022年12月1日 至 2023年11月30日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

## (その他の注記)

(2022年11月30日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	10,481,267,749円
同期中における追加設定元本額	7,656,711,181円
同期中における一部解約元本額	2,029,852,502円
2022年11月30日現在の元本の内訳	
三井住友・DCつみたてNISA・全海外株インデックスファンド	8,414,992,973円
三井住友・DC新興国株式インデックスファンド	2,960,029,922円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	183,852,090円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	291,047,771円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	194,328,149円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	40,006,969円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	100,172,461円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	75,036,325円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	334,887,158円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	274,169,234円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	448,887,023円

三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	103,796,383円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	5,268,543円
日興FWS・新興国株インデックス(為替ヘッジあり)	706,099,778円
日興FWS・新興国株インデックス(為替ヘッジなし)	1,907,693,075円
三井住友DS・新興国株式インデックス・ファンド	13,672,741円
S M A M・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	54,185,833円
合 計	16,108,126,428円

(2023年11月30日現在)

開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	16,108,126,428円
同期中における追加設定元本額	7,192,409,143円
同期中における一部解約元本額	3,145,425,344円
2023年11月30日現在の元本の内訳	
三井住友・DCつみたてNISA・全海外株インデックスファンド	10,969,887,995円
三井住友・DC新興国株式インデックスファンド	3,325,642,113円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	66,389,165円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	210,947,221円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	130,076,082円
イオン・バランス戦略ファンド	51,158,952円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	52,016,576円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	119,247,376円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	89,658,773円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	415,494,050円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	272,564,691円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	393,208,937円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	125,842,039円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	6,117,050円
日興FWS・新興国株インデックス(為替ヘッジあり)	604,006,895円
日興FWS・新興国株インデックス(為替ヘッジなし)	3,156,147,382円
三井住友DS・新興国株式インデックス・ファンド	71,378,661円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2035	623,825円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2040	460,225円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2045	426,243円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2055	139,642円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2065	237,886円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル1(保守型)	139,275円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル2(安定型)	1,962,597円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル3(安定成長型)	8,819,360円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル4(成長型)	5,112,939円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル5(積極成長型)	2,237,206円
S M A M・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	75,167,071円
合 計	20,155,110,227円

## (3) 附属明細表

## 有価証券明細表

## (a) 株式

通貨	銘柄	株数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル	INNER MONGOLIA YITAI COAL-B	36,700	1.472	54,022.40	
	CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	7,495	9.590	71,877.05	
	SOUTHERN COPPER CORP	2,956	71.770	212,152.12	
	ZTO EXPRESS CAYMAN INC-ADR	14,897	22.310	332,352.07	
	NIO INC - ADR	48,147	7.180	345,695.46	
	H WORLD GROUP LTD-ADR	7,199	35.150	253,044.85	
	TAL EDUCATION GROUP- ADR	14,239	12.000	170,868.00	
	YUM CHINA HOLDINGS INC	14,499	43.000	623,457.00	
	MINISO GROUP HOLDING LTD-ADR	2,998	25.930	77,738.14	
	PDD HOLDINGS INC	20,779	141.730	2,945,007.67	
	VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	12,137	16.330	198,197.21	
	LEGEND BIOTECH CORP-ADR	2,074	59.820	124,066.68	
	CREDICORP LTD	2,325	125.930	292,787.25	
	LUFAX HOLDING LTD-ADR	18,837	0.841	15,841.91	
	QIFU TECHNOLOGY INC	3,764	15.600	58,718.40	
	SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-B	20,996	1.973	41,425.10	
	DAQO NEW ENERGY CORP-ADR	2,205	24.280	53,537.40	
	AUTOHOME INC-ADR	2,773	26.310	72,957.63	
	IQIYI INC-ADR	13,729	4.490	61,643.21	
	JOYY INC-ADR	1,560	38.470	60,013.20	
KANZHUN LTD - ADR	7,608	16.720	127,205.76		
TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR	26,103	8.330	217,437.99		
WEIBO CORP-SPON ADR	2,729	11.320	30,892.28		
KE HOLDINGS INC-ADR	23,635	15.950	376,978.25		
アメリカ・ドル小計		310,384		6,817,917.03 (1,002,711,058)	
香港・ドル	CHINA COAL ENERGY CO-H	51,000	6.570	335,070.00	
	CHINA OILFIELD SERVICES-H	74,000	8.340	617,160.00	
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	882,000	4.010	3,536,820.00	
	CHINA SHENHUA ENERGY CO-H	121,500	25.300	3,073,950.00	
	COSCO SHIPPING ENERGY TRAN-H	52,000	7.680	399,360.00	
	PETROCHINA CO LTD-H	750,000	5.070	3,802,500.00	
	YANKUANG ENERGY GROUP CO-H	72,000	14.480	1,042,560.00	
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	110,000	3.810	419,100.00	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	39,000	18.280	712,920.00	
	CHINA HONGQIAO GROUP LTD	94,000	6.180	580,920.00	
	CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	122,000	3.490	425,780.00	
	CHINA RESOURCES CEMENT	78,000	1.820	141,960.00	
	CMOC GROUP LTD-H	150,000	4.420	663,000.00	

DONGYUE GROUP	43,000	6.010	258,430.00	
GANFENG LITHIUM GROUP CO L-H	14,600	25.150	367,190.00	
JIANGXI COPPER CO LTD-H	31,000	11.040	342,240.00	
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	37,000	3.940	145,780.00	
SHANDONG GOLD MINING CO LT-H	25,000	15.260	381,500.00	
ZHAOJIN MINING INDUSTRY - H	54,000	10.320	557,280.00	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	182,000	12.220	2,224,040.00	
AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	99,000	3.490	345,510.00	
BOC AVIATION LTD	6,100	55.750	340,075.00	
CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	54,000	3.410	184,140.00	
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	56,500	5.830	329,395.00	
CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	152,000	3.400	516,800.00	
CHINA STATE CONSTRUCTION INT	64,000	8.900	569,600.00	
CITIC LTD	193,000	7.250	1,399,250.00	
CRRC CORP LTD - H	144,000	3.160	455,040.00	
FOSUN INTERNATIONAL LTD	72,000	4.700	338,400.00	
HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	21,000	19.800	415,800.00	
SANY HEAVY EQUIPMENT INTL	39,000	8.140	317,460.00	
SINOTRUK HONG KONG LTD	30,000	16.160	484,800.00	
WEICHAI POWER CO LTD-H	68,000	14.520	987,360.00	
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRI-H	19,400	24.400	473,360.00	
CHINA EVERBRIGHT ENVIRONMENT	123,000	2.540	312,420.00	
AIR CHINA LTD-H	56,000	5.260	294,560.00	
BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H	44,000	2.890	127,160.00	
CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	38,140	10.100	385,214.00	
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	72,000	3.710	267,120.00	
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-H	100,400	7.040	706,816.00	
COSCO SHIPPING PORTS LTD	66,000	5.370	354,420.00	
JD LOGISTICS INC	70,500	9.700	683,850.00	
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	50,000	6.900	345,000.00	
ORIENT OVERSEAS INTL LTD	4,000	94.250	377,000.00	
SHENZHEN INTL HOLDINGS	49,500	5.910	292,545.00	
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	32,000	4.840	154,880.00	
BYD CO LTD-H	36,500	211.800	7,730,700.00	
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	70,000	3.970	277,900.00	
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	23,600	36.750	867,300.00	
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	219,000	8.760	1,918,440.00	
GREAT WALL MOTOR CO LTD-H	85,000	11.500	977,500.00	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	81,200	3.680	298,816.00	
LI AUTO INC-CLASS A	39,600	152.500	6,039,000.00	
MINTH GROUP LTD	22,000	17.420	383,240.00	
XPENG INC - CLASS A SHARES	35,900	67.650	2,428,635.00	
YADEA GROUP HOLDINGS LTD	48,000	14.600	700,800.00	
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	45,400	80.600	3,659,240.00	

BOSIDENG INTL HLDGS LTD	104,000	3.210	333,840.00	
HAIER SMART HOME CO LTD-H	82,000	22.600	1,853,200.00	
LI NING CO LTD	85,000	21.350	1,814,750.00	
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	30,000	78.000	2,340,000.00	
XTEP INTERNATIONAL HOLDINGS	57,000	4.560	259,920.00	
EAST BUY HOLDING LTD	13,000	29.700	386,100.00	
HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDI	59,000	15.380	907,420.00	
JIUMAOJIU INTERNATIONAL HOLD	36,000	7.910	284,760.00	
MEITUAN-CLASS B	177,060	90.450	16,015,077.00	
NEW ORIENTAL EDUCATION & TEC	52,000	61.700	3,208,400.00	
TONGCHENG TRAVEL HOLDINGS LT	38,400	14.460	555,264.00	
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	29,000	13.480	390,920.00	
TRIP.COM GROUP LTD	19,400	272.800	5,292,320.00	
ALIBABA GROUP HOLDING LTD	571,500	72.700	41,548,050.00	
CHINA MEIDONG AUTO HOLDINGS	22,000	4.660	102,520.00	
CHINA TOURISM GROUP DUTY F-H	2,300	85.200	195,960.00	
CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU	68,200	11.100	757,020.00	
JD.COM INC-CLASS A	82,285	106.600	8,771,581.00	
POP MART INTERNATIONAL GROUP	21,000	23.150	486,150.00	
TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLD	49,000	6.330	310,170.00	
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	33,000	18.120	597,960.00	
ALIBABA HEALTH INFORMATION T	208,000	4.620	960,960.00	
JD HEALTH INTERNATIONAL INC	40,800	37.050	1,511,640.00	
PING AN HEALTHCARE AND TECHN	24,200	17.880	432,696.00	
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-B	3,700	120.490	445,813.00	
CHINA FEIHE LTD	127,000	4.560	579,120.00	
CHINA MENGNIU DAIRY CO	113,000	24.250	2,740,250.00	
CHINA RESOURCES BEER HOLDING	58,000	34.850	2,021,300.00	
NONGFU SPRING CO LTD-H	63,400	43.750	2,773,750.00	
SMOORE INTERNATIONAL HOLDING	58,000	6.940	402,520.00	
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	60,000	9.550	573,000.00	
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	20,000	50.600	1,012,000.00	
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS	28,000	5.090	142,520.00	
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	166,000	4.780	793,480.00	
YIHAI INTERNATIONAL HOLDING	16,000	13.420	214,720.00	
HENGAN INTL GROUP CO LTD	25,500	28.000	714,000.00	
VINDA INTERNATIONAL HOLDINGS	9,000	19.420	174,780.00	
HYGEIA HEALTHCARE HOLDINGS C	10,800	48.050	518,940.00	
MICROPORT SCIENTIFIC CORP	23,700	12.440	294,828.00	
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	78,400	7.280	570,752.00	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	24,700	11.220	277,134.00	
SINOPHARM GROUP CO-H	42,400	19.000	805,600.00	
3SBIO INC	69,000	7.350	507,150.00	
AKESO INC	15,000	49.650	744,750.00	

BEIGENE LTD	24,700	109.700	2,709,590.00	
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	44,000	15.040	661,760.00	
CHINA RESOURCES PHARMACEUTIC	54,500	4.890	266,505.00	
CHINA TRADITIONAL CHINESE ME	86,000	3.850	331,100.00	
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LT	324,800	7.000	2,273,600.00	
GENSCRIPT BIOTECH CORP	36,000	21.850	786,600.00	
HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP	34,000	15.120	514,080.00	
INNOVENT BIOLOGICS INC	42,500	43.850	1,863,625.00	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	16,500	17.340	286,110.00	
SINO BIOPHARMACEUTICAL	327,000	3.740	1,222,980.00	
WUXI APPTec CO LTD-H	13,711	93.300	1,279,236.30	
WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	135,000	44.700	6,034,500.00	
ZAI LAB LTD	29,900	20.800	621,920.00	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	1,049,000	2.860	3,000,140.00	
BANK OF CHINA LTD-H	2,795,000	2.840	7,937,800.00	
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	325,000	4.580	1,488,500.00	
CHINA CITIC BANK CORP LTD-H	303,000	3.560	1,078,680.00	
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	3,364,000	4.480	15,070,720.00	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	77,000	2.170	167,090.00	
CHINA MERCHANTS BANK-H	138,500	27.350	3,787,975.00	
CHINA MINSHENG BANKING COR-H	265,100	2.600	689,260.00	
IND & COMM BK OF CHINA-H	2,288,000	3.720	8,511,360.00	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H	251,000	3.450	865,950.00	
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	400,000	0.760	304,000.00	
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	132,000	4.140	546,480.00	
CHINA INTERNATIONAL CAPITA-H	58,400	12.320	719,488.00	
CITIC SECURITIES CO LTD-H	64,500	16.080	1,037,160.00	
FAR EAST HORIZON LTD	42,000	5.690	238,980.00	
GF SECURITIES CO LTD-H	27,200	9.560	260,032.00	
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	80,800	4.400	355,520.00	
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	43,200	9.710	419,472.00	
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	266,000	10.560	2,808,960.00	
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	96,800	16.600	1,606,880.00	
CHINA TAIPING INSURANCE HOLD	61,000	6.930	422,730.00	
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	30,100	15.500	466,550.00	
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	308,000	2.500	770,000.00	
PICC PROPERTY & CASUALTY-H	250,000	9.030	2,257,500.00	
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	235,000	35.750	8,401,250.00	
ZHONGAN ONLINE P&C INSURAN-H	19,800	19.540	386,892.00	
CHINASOFT INTERNATIONAL LTD	100,000	6.660	666,000.00	
GDS HOLDINGS LTD-CL A	23,900	10.200	243,780.00	
KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR	104,000	11.700	1,216,800.00	
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	20,000	22.000	440,000.00	
BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	29,000	35.250	1,022,250.00	



KINGBOARD HOLDINGS LTD	18,500	19.420	359,270.00	
KINGBOARD LAMINATES HLDG LTD	21,000	7.080	148,680.00	
LENOVO GROUP LTD	240,000	9.600	2,304,000.00	
SUNNY OPTICAL TECH	26,200	73.450	1,924,390.00	
XIAOMI CORP-CLASS B	540,600	15.480	8,368,488.00	
ZTE CORP-H	23,800	16.860	401,268.00	
FLAT GLASS GROUP CO LTD-H	17,000	12.680	215,560.00	
GCL TECHNOLOGY HOLDINGS LTD	642,000	1.050	674,100.00	
HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	19,000	18.080	343,520.00	
XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	154,000	4.480	689,920.00	
CHINA TOWER CORP LTD-H	1,400,000	0.800	1,120,000.00	
BEIJING ENTERPRISES HLDGS	17,000	25.800	438,600.00	
BEIJING ENTERPRISES WATER GR	100,000	1.560	156,000.00	
CGN POWER CO LTD-H	333,000	1.870	622,710.00	
CHINA GAS HOLDINGS LTD	94,400	7.200	679,680.00	
CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	105,000	5.900	619,500.00	
CHINA POWER INTERNATIONAL	148,000	2.840	420,320.00	
CHINA RESOURCES GAS GROUP LT	29,200	24.550	716,860.00	
CHINA RESOURCES POWER HOLDIN	60,000	14.820	889,200.00	
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	29,000	53.200	1,542,800.00	
GUANGDONG INVESTMENT LTD	92,000	5.380	494,960.00	
HUANENG POWER INTL INC-H	152,000	3.810	579,120.00	
KUNLUN ENERGY CO LTD	122,000	7.150	872,300.00	
BAIDU INC-CLASS A	79,050	115.100	9,098,655.00	
BILIBILI INC-CLASS Z	5,980	101.000	603,980.00	
CHINA LITERATURE LTD	12,200	26.600	324,520.00	
CHINA RUYI HOLDINGS LTD	172,000	1.750	301,000.00	
KINGSOFT CORP LTD	33,600	25.450	855,120.00	
KUAISHOU TECHNOLOGY	82,100	56.950	4,675,595.00	
NETEASE INC	67,800	176.800	11,987,040.00	
TENCENT HOLDINGS LTD	233,200	317.000	73,924,400.00	
C&D INTERNATIONAL INVESTMENT	21,000	15.920	334,320.00	
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	160,000	0.890	142,400.00	
CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	138,500	14.420	1,997,170.00	
CHINA OVERSEAS PROPERTY HOLD	50,000	6.440	322,000.00	
CHINA RESOURCES LAND LTD	114,000	28.250	3,220,500.00	
CHINA RESOURCES MIXC LIFESTY	23,400	29.150	682,110.00	
CHINA VANKE CO LTD-H	78,900	7.900	623,310.00	
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD	74,000	7.380	546,120.00	
GREENTOWN CHINA HOLDINGS	45,500	8.110	369,005.00	
LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	63,000	13.640	859,320.00	
YUEXIU PROPERTY CO LTD	64,600	7.130	460,598.00	
香港・ドル小計	28,646,026		384,338,405.30 (7,240,935,556)	

台湾・ドル	FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	40,000	84.500	3,380,000.00	
	ASIA CEMENT CORP	73,000	42.000	3,066,000.00	
	CHINA STEEL CORP	424,000	26.200	11,108,800.00	
	FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	128,000	64.300	8,230,400.00	
	FORMOSA PLASTICS CORP	126,000	81.400	10,256,400.00	
	NAN YA PLASTICS CORP	171,000	68.400	11,696,400.00	
	TAIWAN CEMENT	234,676	34.250	8,037,653.00	
	AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	5,000	1,085.000	5,425,000.00	
	FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	105,000	30.600	3,213,000.00	
	VOLTRONIC POWER TECHNOLOGY	2,000	1,560.000	3,120,000.00	
	WALSIN LIHWA CORP	108,000	39.350	4,249,800.00	
	CHINA AIRLINES LTD	106,000	21.050	2,231,300.00	
	EVA AIRWAYS CORP	91,000	31.000	2,821,000.00	
	EVERGREEN MARINE CORP LTD	39,096	112.000	4,378,752.00	
	TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	64,000	29.850	1,910,400.00	
	WAN HAI LINES LTD	25,605	46.550	1,191,912.75	
	YANG MING MARINE TRANSPORT	55,000	42.550	2,340,250.00	
	CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	63,000	47.300	2,979,900.00	
	ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	6,000	584.000	3,504,000.00	
	FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	15,276	183.000	2,795,508.00	
	GIANT MANUFACTURING	10,000	185.500	1,855,000.00	
	NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	6,000	344.000	2,064,000.00	
	POU CHEN	70,000	30.900	2,163,000.00	
	HOTAI MOTOR COMPANY LTD	10,200	696.000	7,099,200.00	
	MOMO.COM INC	2,420	513.000	1,241,460.00	
	PRESIDENT CHAIN STORE CORP	21,000	270.000	5,670,000.00	
	UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	173,000	72.200	12,490,600.00	
	PHARMAESSENTIA CORP	9,000	367.000	3,303,000.00	
	CHANG HWA COMMERCIAL BANK	189,359	17.950	3,398,994.05	
	CTBC FINANCIAL HOLDING CO LT	613,000	26.850	16,459,050.00	
	E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	504,360	25.550	12,886,398.00	
	FIRST FINANCIAL HOLDING CO	378,501	27.500	10,408,777.50	
	HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	292,970	22.050	6,459,988.50	
	MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	390,585	39.150	15,291,402.75	
	SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	347,551	18.800	6,533,958.80	
	TAISHIN FINANCIAL HOLDING	389,912	18.050	7,037,911.60	
	TAIWAN BUSINESS BANK	213,032	13.500	2,875,932.00	
	TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	365,563	26.700	9,760,532.10	
	THE SHANGHAI COMMERCIAL & SA	121,299	45.300	5,494,844.70	
	CHAILLEASE HOLDING CO LTD	50,832	183.000	9,302,256.00	
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO	368,013	25.950	9,549,937.35		
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	331,000	45.750	15,143,250.00		
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	536,196	12.600	6,756,069.60		
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	271,897	63.700	17,319,838.90		

SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	414,432	9.020	3,738,176.64	
ACCTON TECHNOLOGY CORP	18,000	538.000	9,684,000.00	
ACER INC	111,000	35.350	3,923,850.00	
ADVANTECH CO LTD	15,727	354.000	5,567,358.00	
ASUSTEK COMPUTER INC	25,000	390.000	9,750,000.00	
AUO CORP	222,600	16.500	3,672,900.00	
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	21,000	196.500	4,126,500.00	
COMPAL ELECTRONICS	157,000	30.750	4,827,750.00	
DELTA ELECTRONICS INC	69,000	317.000	21,873,000.00	
E INK HOLDINGS INC	27,000	178.500	4,819,500.00	
GIGABYTE TECHNOLOGY CO LTD	18,000	243.500	4,383,000.00	
HON HAI PRECISION INDUSTRY	436,800	102.000	44,553,600.00	
INNOLUX CORP	292,163	12.600	3,681,253.80	
INVENTEC CORP	87,000	41.600	3,619,200.00	
LARGAN PRECISION CO LTD	3,480	2,385.000	8,299,800.00	
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	73,000	109.000	7,957,000.00	
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	27,000	181.000	4,887,000.00	
NAN YA PRINTED CIRCUIT BOARD	6,000	251.000	1,506,000.00	
PEGATRON CORP	68,000	81.700	5,555,600.00	
QUANTA COMPUTER INC	95,000	201.000	19,095,000.00	
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	37,000	67.900	2,512,300.00	
UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	50,000	175.000	8,750,000.00	
WISTRON CORP	88,000	93.300	8,210,400.00	
WIWYNN CORP	3,000	1,780.000	5,340,000.00	
WPG HOLDINGS LTD	62,520	76.500	4,782,780.00	
YAGEO CORPORATION	10,912	599.000	6,536,288.00	
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	19,000	104.500	1,985,500.00	
ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LT	110,000	127.000	13,970,000.00	
EMEMORY TECHNOLOGY INC	2,000	2,580.000	5,160,000.00	
GLOBAL UNICHIP CORP	3,000	1,625.000	4,875,000.00	
GLOBALWAFERS CO LTD	7,000	584.000	4,088,000.00	
MEDIATEK INC	53,000	948.000	50,244,000.00	
NANYA TECHNOLOGY CORP	35,000	74.200	2,597,000.00	
NOVATEK MICROELECTRONICS COR	19,000	512.000	9,728,000.00	
PARADE TECHNOLOGIES LTD	3,000	1,075.000	3,225,000.00	
POWERCHIP SEMICONDUCTOR MANU	103,000	29.850	3,074,550.00	
REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	18,000	462.500	8,325,000.00	
SILERGY CORP	10,800	427.500	4,617,000.00	
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	857,000	574.000	491,918,000.00	
UNITED MICROELECTRONICS CORP	399,000	49.200	19,630,800.00	
VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	25,000	79.500	1,987,500.00	
WINBOND ELECTRONICS CORP	118,000	28.450	3,357,100.00	
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	135,000	120.000	16,200,000.00	
FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	51,000	81.000	4,131,000.00	

	TAIWAN MOBILE CO LTD	60,000	98.900	5,934,000.00	
	RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	43,443	35.850	1,557,431.55	
	台湾・ドル小計	12,057,220		1,154,759,015.59 (5,440,762,578)	
エジプト・ ポンド	EASTERN CO SAE	47,271	26.200	1,238,500.20	
	COMMERCIAL INTERNATIONAL BAN	87,802	78.000	6,848,556.00	
	EFG HOLDING S.A.E.	19,906	18.750	373,237.50	
	エジプト・ポンド小計	154,979		8,460,293.70 (40,198,238)	
トルコ・リ ラ	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	32,627	154.900	5,053,922.30	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	48,657	41.220	2,005,641.54	
	HEKTAS TICARET T.A.S	31,731	22.860	725,370.66	
	KOZA ALTIN ISLETMELERI AS	37,677	22.880	862,049.76	
	SASA POLYESTER SANAYI	38,018	51.100	1,942,719.80	
	AESLAN ELEKTRONIK SANAYI	38,582	48.000	1,851,936.00	
	KOC HOLDING AS	26,441	143.200	3,786,351.20	
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI	47,908	50.650	2,426,540.20	
	PEGASUS HAVA TASIMACILIGI AS	1,852	715.000	1,324,180.00	
	TURK HAVA YOLLARI AO	18,832	255.000	4,802,160.00	
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	2,571	842.000	2,164,782.00	
	TOFAS TURK OTOMOBIL FABRIKA	4,752	250.500	1,190,376.00	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	15,813	312.000	4,933,656.00	
	AKBANK T.A.S.	108,288	33.920	3,673,128.96	
	HACI OMER SABANCI HOLDING	35,457	62.350	2,210,743.95	
	TURKIYE IS BANKASI-C	128,081	21.940	2,810,097.14	
	YAPI VE KREDI BANKASI	117,430	19.340	2,271,096.20	
TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	42,053	57.250	2,407,534.25		
	トルコ・リラ小計	776,770		46,442,285.96 (236,112,582)	
メキシコ・ ペソ	GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	110,600	75.570	8,358,042.00	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	6,795	250.100	1,699,429.50	
	ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV	40,100	35.990	1,443,199.00	
	ALFA S.A.B. -A	126,300	12.280	1,550,964.00	
	GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	19,800	149.580	2,961,684.00	
	GRUPO AEROPORT DEL PACIFIC-B	12,800	253.710	3,247,488.00	
	GRUPO AEROPORT DEL SURESTE-B	6,600	391.620	2,584,692.00	
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	7,195	167.470	1,204,946.65	
	WALMART DE MEXICO SAB DE CV	184,900	66.970	12,382,753.00	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	17,900	173.610	3,107,619.00	
	GRUMA S.A.B. -B	6,425	321.540	2,065,894.50	
	GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	46,200	86.310	3,987,522.00	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	47,400	34.230	1,622,502.00	
	BANCO DEL BAJIO SA	26,900	55.370	1,489,453.00	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE-0	90,200	157.750	14,229,050.00	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA-0	67,700	41.720	2,824,444.00	

	AMERICA MOVIL SAB DE C-SER B	661,900	15.460	10,232,974.00	
	OPERADORA DE SITIOS MEX- A-1	30,400	21.500	653,600.00	
	メキシコ・ペソ小計	1,510,115		75,646,256.65 (643,795,032)	
フィリピン・ペソ	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	42,090	48.000	2,020,320.00	
	AYALA CORPORATION	9,680	662.000	6,408,160.00	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	82,562	37.700	3,112,587.40	
	SM INVESTMENTS CORP	9,035	848.000	7,661,680.00	
	INTL CONTAINER TERM SVCS INC	38,440	222.800	8,564,432.00	
	JOLLIBEE FOODS CORP	12,830	233.800	2,999,654.00	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	27,990	115.500	3,232,845.00	
	BANK OF THE PHILIPPINE ISLAN	66,506	102.700	6,830,166.20	
	BDO UNIBANK INC	82,344	133.400	10,984,689.60	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	58,720	50.850	2,985,912.00	
	PLDT INC	2,690	1,255.000	3,375,950.00	
	ACEN CORP	10,485	4.660	48,860.10	
	MANILA ELECTRIC COMPANY	10,060	374.000	3,762,440.00	
	AYALA LAND INC	237,900	30.150	7,172,685.00	
SM PRIME HOLDINGS INC	366,400	32.500	11,908,000.00		
	フィリピン・ペソ小計	1,057,732		81,068,381.30 (215,277,087)	
チリ・ペソ	EMPRESAS COPEC SA	13,877	6,555.000	90,963,735.00	
	EMPRESAS CMPC SA	36,662	1,694.100	62,109,094.20	
	SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	5,151	44,000.000	226,644,000.00	
	CIA SUD AMERICANA DE VAPORES	374,056	50.010	18,706,540.56	
	FALABELLA SA	28,182	2,019.000	56,899,458.00	
	CENCOSUD SA	40,071	1,559.000	62,470,689.00	
	CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	5,381	5,329.000	28,675,349.00	
	BANCO DE CHILE	1,530,852	96.300	147,421,047.60	
	BANCO DE CREDITO E INVERSION	2,223	23,590.000	52,440,570.00	
	BANCO SANTANDER CHILE	2,408,919	42.300	101,897,273.70	
	ENEL AMERICAS SA	843,379	99.500	83,916,210.50	
	ENEL CHILE SA	971,320	55.650	54,053,958.00	
	チリ・ペソ小計	6,260,073		986,197,925.56 (166,746,345)	
コロンビア・ペソ	BANCOLOMBIA SA	9,763	30,220.000	295,037,860.00	
	BANCOLOMBIA SA-PREF	15,218	27,900.000	424,582,200.00	
	INTERCONEXION ELECTRICA SA	14,643	15,160.000	221,987,880.00	
	コロンビア・ペソ小計	39,624		941,607,940.00 (34,670,004)	
インド・ルピー	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	25,859	428.650	11,084,460.35	
	COAL INDIA LTD	52,468	342.350	17,962,419.80	
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP	15,734	342.450	5,388,108.30	
	INDIAN OIL CORP LTD	89,126	108.550	9,674,627.30	
	OIL & NATURAL GAS CORP LTD	106,477	192.000	20,443,584.00	

PETRONET LNG LTD	27,436	199.200	5,465,251.20	
RELIANCE INDUSTRIES LTD	105,896	2,400.700	254,224,527.20	
AMBUJA CEMENTS LTD	19,152	435.650	8,343,568.80	
ASIAN PAINTS LTD	13,624	3,148.350	42,893,120.40	
BERGER PAINTS INDIA LTD	8,319	574.050	4,775,521.95	
GRASIM INDUSTRIES LTD	8,842	2,003.250	17,712,736.50	
HINDALCO INDUSTRIES LTD	41,646	517.450	21,549,722.70	
JINDAL STEEL & POWER LTD	11,377	668.550	7,606,093.35	
JSW STEEL LTD	19,429	793.250	15,412,054.25	
PI INDUSTRIES LTD	2,663	3,782.150	10,071,865.45	
PIDILITE INDUSTRIES LTD	4,812	2,503.600	12,047,323.20	
SHREE CEMENT LTD	324	26,106.900	8,458,635.60	
SRF LTD	5,058	2,351.700	11,894,898.60	
SUPREME INDUSTRIES LTD	2,423	4,121.300	9,985,909.90	
TATA STEEL LTD	262,781	127.750	33,570,272.75	
ULTRATECH CEMENT LTD	4,130	8,732.750	36,066,257.50	
UPL LTD	15,397	570.050	8,777,059.85	
VEDANTA LTD	20,729	233.450	4,839,185.05	
ABB INDIA LTD	2,065	4,244.050	8,763,963.25	
ADANI ENTERPRISES LTD	5,498	2,396.600	13,176,506.80	
ASHOK LEYLAND LTD	56,114	181.450	10,181,885.30	
ASTRAL LTD	4,691	1,945.750	9,127,513.25	
BHARAT ELECTRONICS LTD	134,202	141.000	18,922,482.00	
CG POWER AND INDUSTRIAL SOLU	19,270	439.250	8,464,347.50	
CUMMINS INDIA LTD	5,373	1,873.650	10,067,121.45	
HAVELLS INDIA LTD	9,425	1,288.050	12,139,871.25	
HINDUSTAN AERONAUTICS LTD	5,374	2,343.400	12,593,431.60	
LARSEN & TOUBRO LTD	24,291	3,083.750	74,907,371.25	
SIEMENS LTD	2,862	3,635.750	10,405,516.50	
INDIAN RAILWAY CATERING & TO	6,819	700.500	4,776,709.50	
ADANI PORTS AND SPECIAL ECON	19,519	835.550	16,309,100.45	
CONTAINER CORP OF INDIA LTD	10,064	768.150	7,730,661.60	
INTERGLOBE AVIATION LTD	4,338	2,689.550	11,667,267.90	
BAJAJ AUTO LTD	2,566	6,069.950	15,575,491.70	
BALKRISHNA INDUSTRIES LTD	2,486	2,582.550	6,420,219.30	
BHARAT FORGE LTD	8,900	1,114.700	9,920,830.00	
EICHER MOTORS LTD	4,755	3,812.250	18,127,248.75	
HERO MOTOCORP LTD	3,820	3,746.900	14,313,158.00	
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	32,414	1,619.100	52,481,507.40	
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	4,723	10,599.250	50,060,257.75	
MRF LTD	70	112,266.550	7,858,658.50	
SAMVARDHANA MOTHERSON INTERN	74,623	92.550	6,906,358.65	
SONA BLW PRECISION FORGINGS	13,173	554.800	7,308,380.40	
TATA MOTORS LTD	57,726	712.350	41,121,116.10	

TUBE INVESTMENTS OF INDIA LT	3,415	3,453.250	11,792,848.75	
TVS MOTOR CO LTD	7,637	1,863.650	14,232,695.05	
PAGE INDUSTRIES LTD	194	37,353.750	7,246,627.50	
TITAN CO LTD	12,654	3,429.300	43,394,362.20	
INDIAN HOTELS CO LTD	27,400	420.050	11,509,370.00	
JUBILANT FOODWORKS LTD	14,355	563.250	8,085,453.75	
ZOMATO LTD	137,493	116.600	16,031,683.80	
TRENT LTD	6,771	2,676.400	18,121,904.40	
AVENUE SUPERMARTS LTD	5,654	3,861.500	21,832,921.00	
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	3,767	4,803.650	18,095,349.55	
ITC LTD	105,944	437.200	46,318,716.80	
MARICO LTD	18,008	527.000	9,490,216.00	
NESTLE INDIA LTD	1,217	24,067.500	29,290,147.50	
TATA CONSUMER PRODUCTS LTD	18,760	933.550	17,513,398.00	
UNITED SPIRITS LTD	10,302	1,050.550	10,822,766.10	
VARUN BEVERAGES LTD	15,648	1,060.850	16,600,180.80	
COLGATE PALMOLIVE (INDIA)	4,747	2,208.450	10,483,512.15	
DABUR INDIA LTD	21,140	534.600	11,301,444.00	
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	14,218	1,001.100	14,233,639.80	
HINDUSTAN UNILEVER LTD	28,964	2,525.050	73,135,548.20	
APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE	3,236	5,421.950	17,545,430.20	
MAX HEALTHCARE INSTITUTE LTD	24,969	613.250	15,312,239.25	
AUROBINDO PHARMA LTD	8,477	1,021.450	8,658,831.65	
CIPLA LTD	19,015	1,201.550	22,847,473.25	
DIVI'S LABORATORIES LTD	3,911	3,729.750	14,587,052.25	
DR. REDDY'S LABORATORIES	3,932	5,715.350	22,472,756.20	
LUPIN LTD	6,582	1,249.550	8,224,538.10	
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	34,226	1,202.200	41,146,497.20	
TORRENT PHARMACEUTICALS LTD	3,264	2,091.850	6,827,798.40	
AU SMALL FINANCE BANK LTD	6,667	748.250	4,988,582.75	
AXIS BANK LTD	79,208	1,060.150	83,972,361.20	
BANDHAN BANK LTD	26,591	222.350	5,912,508.85	
BANK OF BARODA	38,009	197.400	7,502,976.60	
HDFC BANK LIMITED	96,928	1,559.150	151,125,291.20	
ICICI BANK LTD	179,956	939.600	169,086,657.60	
IDFC FIRST BANK LTD	112,874	84.900	9,583,002.60	
KOTAK MAHINDRA BANK LTD	38,079	1,753.450	66,769,622.55	
STATE BANK OF INDIA	62,035	568.600	35,273,101.00	
YES BANK LTD	449,730	19.850	8,927,140.50	
BAJAJ FINANCE LTD	9,476	7,130.100	67,564,827.60	
BAJAJ FINSERV LTD	13,269	1,653.500	21,940,291.50	
BAJAJ HOLDINGS AND INVESTMEN	859	7,309.350	6,278,731.65	
CHOLAMANDALAM INVESTMENT AND	14,064	1,110.450	15,617,368.80	
HDFC ASSET MANAGEMENT CO LTD	2,968	2,932.750	8,704,402.00	

	JIO FINANCIAL SERVICES LTD	105,812	226.050	23,918,802.60	
	MUTHOOT FINANCE LTD	4,186	1,415.850	5,926,748.10	
	POWER FINANCE CORPORATION	45,876	328.100	15,051,915.60	
	REC LTD	45,100	342.900	15,464,790.00	
	SBI CARDS & PAYMENT SERVICES	10,068	737.200	7,422,129.60	
	SHRIRAM FINANCE LTD	10,283	1,974.350	20,302,241.05	
	HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	33,620	675.650	22,715,353.00	
	ICICI LOMBARD GENERAL INSURA	7,594	1,440.600	10,939,916.40	
	ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURA	12,502	551.700	6,897,353.40	
	SBI LIFE INSURANCE CO LTD	15,655	1,407.850	22,039,891.75	
	HCL TECHNOLOGIES LTD	33,762	1,333.950	45,036,819.90	
	INFOSYS LTD	116,069	1,459.600	169,414,312.40	
	LTIMINDTREE LTD	3,273	5,588.500	18,291,160.50	
	MPHASIS LTD	2,360	2,344.850	5,533,846.00	
	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	31,793	3,513.750	111,712,653.75	
	TATA ELXSI LTD	1,081	8,388.550	9,068,022.55	
	TECH MAHINDRA LTD	19,431	1,221.700	23,738,852.70	
	WIPRO LTD	43,286	406.250	17,584,937.50	
	BHARTI AIRTEL LTD	78,764	995.400	78,401,685.60	
	ADANI GREEN ENERGY LTD	12,008	1,041.700	12,508,733.60	
	ADANI POWER LTD	24,800	433.100	10,740,880.00	
	GAIL INDIA LTD	71,754	125.900	9,033,828.60	
	INDRAPRASTHA GAS LTD	11,856	390.300	4,627,396.80	
	NTPC LTD	156,030	258.400	40,318,152.00	
	POWER GRID CORP OF INDIA LTD	166,822	211.050	35,207,783.10	
	TATA POWER CO LTD	53,868	273.400	14,727,511.20	
	INFO EDGE INDIA LTD	2,239	4,547.650	10,182,188.35	
	DLF LTD	21,945	637.650	13,993,229.25	
	GODREJ PROPERTIES LTD	4,022	1,840.000	7,400,480.00	
	インド・ルピー小計	4,221,335		3,056,178,063.70 (5,439,996,952)	
インドネシ ア・ルピア	ADARO ENERGY INDONESIA TBK P	454,200	2,580.000	1,171,836,000.00	
	UNITED TRACTORS TBK PT	46,800	22,450.000	1,050,660,000.00	
	ANEKA TAMBANG TBK	303,800	1,700.000	516,460,000.00	
	BARITO PACIFIC TBK PT	891,211	1,030.000	917,947,330.00	
	INDAH KIAT PULP & PAPER TBK	90,200	8,800.000	793,760,000.00	
	MERDEKA COPPER GOLD TBK PT	380,461	2,460.000	935,934,060.00	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK	91,200	6,400.000	583,680,000.00	
	VALE INDONESIA TBK	103,800	4,690.000	486,822,000.00	
	ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	731,200	5,525.000	4,039,880,000.00	
	GOTO GOJEK TOKOPEDIA TBK PT	30,787,100	94.000	2,893,987,400.00	
	SUMBER ALFARIA TRIJAYA TBK P	524,200	2,810.000	1,473,002,000.00	
	CHAROEN POKPHAND INDONESIA PT	260,300	5,050.000	1,314,515,000.00	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	71,100	10,500.000	746,550,000.00	



	INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK P	143,900	6,425.000	924,557,500.00	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	240,800	3,630.000	874,104,000.00	
	KALBE FARMA TBK PT	665,700	1,605.000	1,068,448,500.00	
	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	1,947,400	8,900.000	17,331,860,000.00	
	BANK MANDIRI PERSERO TBK PT	1,327,300	5,850.000	7,764,705,000.00	
	BANK NEGARA INDONESIA PERSER	498,200	5,225.000	2,603,095,000.00	
	BANK RAKYAT INDONESIA PERSER	2,392,400	5,300.000	12,679,720,000.00	
	SARANA MENARA NUSANTARA PT	878,600	990.000	869,814,000.00	
	TELKOM INDONESIA PERSERO TBK	1,768,600	3,720.000	6,579,192,000.00	
	インドネシア・ルピア小計	44,598,472		67,620,529,790.00 (649,157,086)	
ブラジル・ リアル	COSAN SA	42,588	17.490	744,864.12	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	130,900	37.350	4,889,115.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	167,300	35.230	5,893,979.00	
	PRIIO SA	27,800	45.910	1,276,298.00	
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	26,800	24.720	662,496.00	
	CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	20,900	16.290	340,461.00	
	GERDAU SA-PREF	42,440	22.350	948,534.00	
	SUZANO SA	28,415	54.250	1,541,513.75	
	VALE SA	119,188	73.450	8,754,358.60	
	WEG SA	59,960	34.130	2,046,434.80	
	CCR SA	32,700	13.380	437,526.00	
	LOCALIZA RENT A CAR	32,230	59.230	1,908,982.90	
	RUMO SA	47,600	22.900	1,090,040.00	
	LOJAS RENNER S.A.	29,658	16.090	477,197.22	
	MAGAZINE LUIZA SA	110,400	1.880	207,552.00	
	VIBRA ENERGIA SA	40,280	22.620	911,133.60	
	ATACADAO SA	19,900	11.310	225,069.00	
	RAIA DROGASIL SA	43,280	28.330	1,226,122.40	
	SENDAS DISTRIBUIDORA SA	43,700	13.170	575,529.00	
	AMBEV SA	168,300	13.300	2,238,390.00	
	JBS SA	23,700	23.210	550,077.00	
	NATURA &CO HOLDING SA	28,400	16.220	460,648.00	
	HAPVIDA PARTICIPACOES E INVE	174,519	4.450	776,609.55	
	REDE D'OR SAO LUIZ SA	20,200	26.080	526,816.00	
	HYPERA SA	13,000	33.200	431,600.00	
	BANCO BRADESCO S.A.	59,481	14.150	841,656.15	
BANCO BRADESCO SA-PREF	184,636	16.130	2,978,178.68		
BANCO DO BRASIL S.A.	31,100	52.730	1,639,903.00		
ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF	168,400	31.110	5,238,924.00		
ITAUSA SA	188,480	9.550	1,799,984.00		
B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	202,200	13.250	2,679,150.00		
BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	26,200	31.450	823,990.00		
TOTVS SA	18,400	33.480	616,032.00		

	TELEFONICA BRASIL S.A.	13,500	52.620	710,370.00	
	TIM SA	29,400	17.050	501,270.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	43,705	40.740	1,780,541.70	
	CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	8,000	44.720	357,760.00	
	CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	43,899	10.820	474,987.18	
	CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	10,800	66.830	721,764.00	
	CPFL ENERGIA SA	7,300	36.260	264,698.00	
	ENEVA SA	32,200	12.350	397,670.00	
	ENGIE BRASIL ENERGIA SA	6,450	43.260	279,027.00	
	EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	33,100	34.160	1,130,696.00	
	ブラジル・リアル小計	2,601,409		62,377,948.65 (1,868,855,817)	
チェコ・コ ルナ	KOMERCNI BANKA AS	2,214	691.500	1,530,981.00	
	MONETA MONEY BANK AS	12,093	90.900	1,099,253.70	
	CEZ AS	5,878	979.000	5,754,562.00	
	チェコ・コルナ小計	20,185		8,384,796.70 (55,807,530)	
韓国・ウォ ン	HD HYUNDAI	1,340	61,000.000	81,740,000.00	
	SK INNOVATION CO LTD	2,157	142,300.000	306,941,100.00	
	S-OIL CORP	1,775	69,100.000	122,652,500.00	
	ECOPRO CO LTD	707	740,000.000	523,180,000.00	
	HANWHA SOLUTIONS CORP	3,543	32,500.000	115,147,500.00	
	HYUNDAI STEEL CO	2,767	35,100.000	97,121,700.00	
	KOREA ZINC CO LTD	285	493,000.000	140,505,000.00	
	KUMHO PETROCHEMICAL CO LTD	531	127,600.000	67,755,600.00	
	LG CHEM LTD	1,744	504,000.000	878,976,000.00	
	LG CHEM LTD-PREFERENCE	227	313,500.000	71,164,500.00	
	LOTTE CHEMICAL CORP	723	157,000.000	113,511,000.00	
	POSCO HOLDINGS INC	2,525	483,000.000	1,219,575,000.00	
	SK IE TECHNOLOGY CO LTD	960	70,100.000	67,296,000.00	
	SKC CO LTD	496	95,600.000	47,417,600.00	
	DOOSAN BOBCAT INC	2,210	45,250.000	100,002,500.00	
	DOOSAN ENERBILITY CO LTD	15,235	15,070.000	229,591,450.00	
	ECOPRO BM CO LTD	1,748	269,500.000	471,086,000.00	
	GS HOLDINGS	1,178	42,400.000	49,947,200.00	
	HANWHA AEROSPACE CO LTD	1,139	123,100.000	140,210,900.00	
	HANWHA OCEAN CO LTD	1,903	26,800.000	51,000,400.00	
	HD HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES	830	122,700.000	101,841,000.00	
	HD KOREA SHIPBUILDING & OFFS	1,365	107,500.000	146,737,500.00	
	HYUNDAI ENGINEERING & CONST	2,816	35,850.000	100,953,600.00	
	HYUNDAI MIPO DOCKYARD	668	78,700.000	52,571,600.00	
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	2,283	46,350.000	105,817,050.00		
LG CORP	3,469	82,200.000	285,151,800.00		
LG ENERGY SOLUTION	1,655	447,000.000	739,785,000.00		

POSCO FUTURE M CO LTD	1,037	327,500.000	339,617,500.00	
POSCO INTERNATIONAL CORP	1,697	58,000.000	98,426,000.00	
SAMSUNG C&T CORP	2,774	117,800.000	326,777,200.00	
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	5,041	25,000.000	126,025,000.00	
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	21,785	8,020.000	174,715,700.00	
SK INC	1,219	164,700.000	200,769,300.00	
SK SQUARE CO LTD	3,184	49,950.000	159,040,800.00	
HMM CO LTD	7,862	15,450.000	121,467,900.00	
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	741	177,700.000	131,675,700.00	
KOREAN AIR LINES CO LTD	6,388	22,100.000	141,174,800.00	
PAN OCEAN CO LTD	10,467	4,370.000	45,740,790.00	
HANKOOK TIRE & TECHNOLOGY CO	2,114	44,900.000	94,918,600.00	
HANON SYSTEMS	8,177	7,190.000	58,792,630.00	
HYUNDAI MOBIS CO LTD	2,130	230,500.000	490,965,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO	4,779	184,800.000	883,159,200.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PRF	1,296	109,600.000	142,041,600.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PRF	913	108,700.000	99,243,100.00	
KIA CORP	9,082	86,000.000	781,052,000.00	
COWAY CO LTD	1,996	50,400.000	100,598,400.00	
F&F CO LTD / NEW	502	84,700.000	42,519,400.00	
LG ELECTRONICS INC	3,852	103,400.000	398,296,800.00	
KANGWON LAND INC	3,691	15,540.000	57,358,140.00	
HOTEL SHILLA CO LTD	1,159	64,600.000	74,871,400.00	
BGF RETAIL CO LTD	193	132,500.000	25,572,500.00	
CJ CHEILJEDANG CORP	261	315,500.000	82,345,500.00	
KT&G CORP	3,477	88,500.000	307,714,500.00	
ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	694	116,600.000	80,920,400.00	
AMOREPACIFIC CORP	1,133	132,900.000	150,575,700.00	
LG H&H	359	331,500.000	119,008,500.00	
CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	3,439	71,300.000	245,200,700.00	
HLB INC	4,048	31,950.000	129,333,600.00	
CELLTRION INC	3,921	161,700.000	634,025,700.00	
CELLTRION PHARM INC	364	79,600.000	28,974,400.00	
HANMI PHARM CO LTD	174	303,500.000	52,809,000.00	
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	639	729,000.000	465,831,000.00	
SK BIOPHARMACEUTICALS CO LTD	1,033	84,700.000	87,495,100.00	
SK BIOSCIENCE CO LTD	902	67,800.000	61,155,600.00	
YUHAN CORP	1,951	61,700.000	120,376,700.00	
HANA FINANCIAL GROUP	10,681	41,250.000	440,591,250.00	
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	11,154	11,720.000	130,724,880.00	
KAKAOBANK CORP	5,365	26,000.000	139,490,000.00	
KB FINANCIAL GROUP INC	13,323	51,700.000	688,799,100.00	
SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	15,313	36,300.000	555,861,900.00	
WOORI FINANCIAL GROUP INC	22,480	12,800.000	287,744,000.00	

KAKAOPAY CORP	839	45,550.000	38,216,450.00		
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	1,369	58,200.000	79,675,800.00		
MERITZ FINANCIAL GROUP INC	3,907	54,200.000	211,759,400.00		
MIRAE ASSET SECURITIES CO LT	8,457	7,080.000	59,875,560.00		
NH INVESTMENT & SECURITIES C	5,391	10,280.000	55,419,480.00		
SAMSUNG SECURITIES CO LTD	2,379	38,350.000	91,234,650.00		
DB INSURANCE CO LTD	1,789	81,500.000	145,803,500.00		
SAMSUNG FIRE & MARINE INS	1,033	262,000.000	270,646,000.00		
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LT	2,525	69,400.000	175,235,000.00		
SAMSUNG SDS CO LTD	1,205	166,200.000	200,271,000.00		
COSMOAM&T CO LTD	821	164,600.000	135,136,600.00		
L&F CO LTD	811	168,700.000	136,815,700.00		
LG DISPLAY CO LTD	7,290	12,430.000	90,614,700.00		
LG INNOTEK CO LTD	495	236,500.000	117,067,500.00		
LOTTE ENERGY MATERIALS CORP	643	44,950.000	28,902,850.00		
SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	1,801	146,100.000	263,126,100.00		
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	166,216	72,700.000	12,083,903,200.00		
SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	28,599	57,800.000	1,653,022,200.00		
SAMSUNG SDI CO LTD	1,912	471,500.000	901,508,000.00		
HANMI SEMICONDUCTOR CO LTD	1,522	61,100.000	92,994,200.00		
SK HYNIX INC	19,106	130,400.000	2,491,422,400.00		
KT CORP	2,098	33,300.000	69,863,400.00		
LG UPLUS CORP	6,942	10,410.000	72,266,220.00		
KOREA ELECTRIC POWER CORP	9,785	18,570.000	181,707,450.00		
HYBE CO LTD	587	215,000.000	126,205,000.00		
JYP ENTERTAINMENT CORP	1,121	93,900.000	105,261,900.00		
KAKAO CORP	11,126	50,500.000	561,863,000.00		
KAKAO GAMES CORP	1,454	26,900.000	39,112,600.00		
KRAFTON INC	1,009	216,000.000	217,944,000.00		
NAVER CORP	4,633	207,500.000	961,347,500.00		
NCSOFT CORP	485	263,500.000	127,797,500.00		
NETMARBLE CORP	678	58,900.000	39,934,200.00		
PEARL ABYSS CORP	1,209	38,600.000	46,667,400.00		
韓国・ウォン小計	558,306		38,224,096,950.00 (4,361,369,462)		
マレーシ ア・リン ギット	DIALOG GROUP BHD	135,200	2.070	279,864.00	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	7,300	22.120	161,476.00	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	105,000	7.080	743,400.00	
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDIN	140,100	4.890	685,089.00	
	GAMUDA BHD	57,800	4.560	263,568.00	
	SIME DARBY BERHAD	93,800	2.400	225,120.00	
	MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	30,900	7.300	225,570.00	
	MISC BHD	42,800	7.200	308,160.00	
	GENTING BHD	60,200	4.710	283,542.00	

	GENTING MALAYSIA BHD	124,300	2.690	334,367.00	
	MR DIY GROUP M BHD	136,150	1.550	211,032.50	
	IOI CORP BHD	101,000	3.990	402,990.00	
	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	13,900	21.500	298,850.00	
	NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	2,300	121.700	279,910.00	
	PPB GROUP BERHAD	20,240	13.980	282,955.20	
	QL RESOURCES BHD	29,250	5.410	158,242.50	
	SIME DARBY PLANTATION BHD	59,300	4.550	269,815.00	
	IHH HEALTHCARE BHD	85,700	5.830	499,631.00	
	AMMB HOLDINGS BHD	68,900	4.050	279,045.00	
	CIMB GROUP HOLDINGS BHD	215,700	5.640	1,216,548.00	
	HONG LEONG BANK BERHAD	22,700	19.100	433,570.00	
	HONG LEONG FINANCIAL GROUP	5,700	16.400	93,480.00	
	MALAYAN BANKING BHD	194,500	9.040	1,758,280.00	
	PUBLIC BANK BERHAD	518,100	4.240	2,196,744.00	
	RHB BANK BHD	48,000	5.490	263,520.00	
	INARI AMERTRON BHD	92,100	2.880	265,248.00	
	AXIATA GROUP BERHAD	89,500	2.300	205,850.00	
	CELCOMDIGI BHD	123,800	4.130	511,294.00	
	MAXIS BHD	85,300	3.900	332,670.00	
	TELEKOM MALAYSIA BHD	34,000	5.240	178,160.00	
	PETRONAS GAS BHD	30,700	16.840	516,988.00	
	TENAGA NASIONAL BHD	84,900	9.880	838,812.00	
	マレーシア・リングgit小計	2,859,140		15,003,791.20 (473,996,771)	
南アフリ カ・ランド	EXXARO RESOURCES LTD	7,716	188.940	1,457,861.04	
	AFRICAN RAINBOW MINERALS LTD	3,545	179.790	637,355.55	
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	2,321	806.530	1,871,956.13	
	ANGLOGOLD ASHANTI PLC	15,268	359.890	5,494,800.52	
	GOLD FIELDS LTD	31,972	282.760	9,040,402.72	
	HARMONY GOLD MINING CO LTD	18,015	116.270	2,094,604.05	
	IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	32,232	76.440	2,463,814.08	
	KUMBA IRON ORE LTD	2,544	602.620	1,533,065.28	
	NORTHAM PLATINUM HOLDINGS LT	14,047	122.370	1,718,931.39	
	SASOL LTD	20,736	215.340	4,465,290.24	
	SIBANYE STILLWATER LTD	89,325	20.780	1,856,173.50	
	BIDVEST GROUP LTD	9,128	235.310	2,147,909.68	
	NASPERS LTD-N SHS	6,820	3,429.630	23,390,076.60	
	PEPKOR HOLDINGS LTD	70,079	18.500	1,296,461.50	
	WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	32,847	68.270	2,242,464.69	
	BID CORP LTD	12,198	411.000	5,013,378.00	
	CLICKS GROUP LTD	7,700	297.340	2,289,518.00	
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	18,303	259.780	4,754,753.34	
ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	11,970	182.110	2,179,856.70		

	ABSA GROUP LTD	29,464	172.950	5,095,798.80	
	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	3,026	1,960.370	5,932,079.62	
	NEDBANK GROUP LTD	14,528	213.150	3,096,643.20	
	STANDARD BANK GROUP LTD	46,594	197.790	9,215,827.26	
	FIRSTRAND LTD	175,462	67.360	11,819,120.32	
	REINET INVESTMENTS SCA	4,918	438.530	2,156,690.54	
	REMGRO LTD	16,702	144.450	2,412,603.90	
	DISCOVERY LTD	18,855	135.350	2,552,024.25	
	OLD MUTUAL LTD	170,915	11.740	2,006,542.10	
	OUTSURANCE GROUP LTD	26,578	42.260	1,123,186.28	
	SANLAM LTD	61,250	67.950	4,161,937.50	
	MTN GROUP LTD	58,939	101.000	5,952,839.00	
	VODACOM GROUP LTD	21,750	98.940	2,151,945.00	
	NEPI ROCKCASTLE N.V.	14,414	116.090	1,673,321.26	
	南アフリカ・ランド小計	1,070,161		135,299,232.04 (1,062,098,972)	
タイ・パ ーツ	BANPU PUBLIC CO LTD-NVDR	253,400	7.700	1,951,180.00	
	PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	46,200	153.000	7,068,600.00	
	PTT PCL-NVDR	359,000	35.000	12,565,000.00	
	THAI OIL PCL-NVDR	33,900	51.250	1,737,375.00	
	INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	54,400	25.250	1,373,600.00	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	78,600	38.500	3,026,100.00	
	SCG PACKAGING PCL-NVDR	41,600	38.750	1,612,000.00	
	SIAM CEMENT PCL-NVDR	25,700	290.000	7,453,000.00	
	AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR	154,600	59.000	9,121,400.00	
	BANGKOK EXPRESSWAY-NVDR	221,600	7.750	1,717,400.00	
	BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	229,500	7.100	1,629,450.00	
	ASSET WORLD CORP PCL-NVDR	184,500	3.640	671,580.00	
	MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	126,300	27.000	3,410,100.00	
	CENTRAL RETAIL CORP PCL-NVDR	50,491	38.750	1,956,526.25	
	HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	235,400	11.900	2,801,260.00	
	PTT OIL & RETAIL BUSINE-NVDR	110,600	20.100	2,223,060.00	
	BERLI JUCKER PUBLIC CO-NVDR	42,800	25.500	1,091,400.00	
	CP ALL PCL-NVDR	209,200	51.750	10,826,100.00	
	CP AXTRA PCL-NVDR	77,100	25.500	1,966,050.00	
	CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	154,600	19.700	3,045,620.00	
	OSOTSPA PCL-NVDR	38,500	23.200	893,200.00	
	BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	401,400	26.250	10,536,750.00	
	BUMRUNGRAD HOSPITAL PCL-NVDR	22,300	216.000	4,816,800.00	
	KASIKORNBANK PCL-NVDR	23,700	131.500	3,116,550.00	
	KRUNG THAI BANK - NVDR	103,500	18.400	1,904,400.00	
	SCB X PCL-NVDR	30,600	99.750	3,052,350.00	
	TMBTHANACHART BANK PCL-NVDR	1,077,800	1.570	1,692,146.00	
	KRUNGTHAI CARD PCL-NVDR	27,100	47.500	1,287,250.00	

	MUANGTHAI CAPITAL PCL-NVDR	16,200	44.750	724,950.00	
	DELTA ELECTRONICS THAI-NVDR	112,100	77.000	8,631,700.00	
	ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	39,300	218.000	8,567,400.00	
	INTOUCH HOLDINGS PCL-NVDR	35,900	70.750	2,539,925.00	
	TRUE CORP PCL/NEW-NVDR	333,267	5.950	1,982,938.65	
	B GRIMM POWER PCL-NVDR	20,900	26.750	559,075.00	
	ELECTRICITY GENERA PCL-NVDR	10,400	134.000	1,393,600.00	
	ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR	57,500	46.250	2,659,375.00	
	GLOBAL POWER SYNERGY-NVDR	27,400	47.750	1,308,350.00	
	GULF ENERGY DEVELOPMENT-NVDR	99,400	46.250	4,597,250.00	
	RATCH GROUP PCL-NVDR	37,900	35.000	1,326,500.00	
	CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	76,200	66.500	5,067,300.00	
	LAND & HOUSES PUB - NVDR	233,200	7.700	1,795,640.00	
	タイ・パーツ小計	5,514,058		145,700,250.90 (614,855,059)	
ポーランド・ズロチ	ORLEN SA	20,938	59.600	1,247,904.80	
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	4,782	117.250	560,689.50	
	BUDIMEX	546	552.000	301,392.00	
	LPP SA	35	14,600.000	511,000.00	
	ALLEGRO.EU SA	17,996	28.990	521,704.04	
	PEPCO GROUP NV	5,020	22.500	112,950.00	
	DINO POLSKA SA	1,669	450.000	751,050.00	
	BANK PEKAO SA	6,831	140.150	957,364.65	
	MBANK SA	477	563.200	268,646.40	
	PKO BANK POLSKI SA	29,089	47.750	1,388,999.75	
	SANTANDER BANK POLSKA SA	1,143	504.500	576,643.50	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	20,323	45.740	929,574.02	
	PGE SA	36,813	8.332	306,725.91	
	CD PROJEKT SA	2,415	104.200	251,643.00	
CYFROWY POLSAT SA	5,742	12.250	70,339.50		
	ポーランド・ズロチ小計	153,819		8,756,627.07 (325,608,172)	
ハンガリー・フォリント	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS PL	14,232	2,780.000	39,564,960.00	
	RICHTER GEDEON NYRT	5,283	8,590.000	45,380,970.00	
	OTP BANK PLC	8,272	14,350.000	118,703,200.00	
	ハンガリー・フォリント小計	27,787		203,649,130.00 (86,995,446)	
ユーロ	MOTOR OIL (HELLAS) SA	2,780	25.000	69,500.00	
	MYTILINEOS S.A.	3,556	36.180	128,656.08	
	FF GROUP	123	4.800	590.40	
	OPAP SA	6,174	14.780	91,251.72	
	JUMBO SA	3,650	24.000	87,600.00	
	ALPHA SERVICES AND HOLDINGS	70,399	1.554	109,400.04	
	EUROBANK ERGASIAS SERVICES A	97,148	1.687	163,888.67	
	NATIONAL BANK OF GREECE	20,783	6.200	128,854.60	

	PIRAEUS FINANCIAL HOLDINGS S	27,191	3.208	87,228.72	
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	6,284	13.180	82,823.12	
	PUBLIC POWER CORP	6,630	10.690	70,874.70	
	ユーロ小計	244,718		1,020,668.05 (164,848,097)	
	合計	112,682,313		30,124,797,843 (30,124,797,843)	

(注) 金額欄の( )内は、外貨建有価証券にかかるものの内書きであり、また邦貨換算金額で表示しております。

通貨	銘柄数		組入株式時価比率	合計金額に対する比率
アメリカ・ドル	株式	24銘柄	2.7%	3.3%
香港・ドル	株式	187銘柄	19.5%	24.0%
台湾・ドル	株式	90銘柄	14.7%	18.1%
エジプト・ポンド	株式	3銘柄	0.1%	0.1%
トルコ・リラ	株式	18銘柄	0.6%	0.8%
メキシコ・ペソ	株式	18銘柄	1.7%	2.1%
フィリピン・ペソ	株式	15銘柄	0.6%	0.7%
チリ・ペソ	株式	12銘柄	0.4%	0.6%
コロンビア・ペソ	株式	3銘柄	0.1%	0.1%
インド・ルピー	株式	122銘柄	14.7%	18.1%
インドネシア・ルピア	株式	22銘柄	1.8%	2.2%
ブラジル・レアル	株式	43銘柄	5.0%	6.2%
チェコ・コルナ	株式	3銘柄	0.2%	0.2%
韓国・ウォン	株式	104銘柄	11.8%	14.5%
マレーシア・リンギット	株式	32銘柄	1.3%	1.6%
南アフリカ・ランド	株式	33銘柄	2.9%	3.5%
タイ・バーツ	株式	41銘柄	1.7%	2.0%
ポーランド・ズロチ	株式	15銘柄	0.9%	1.1%
ハンガリー・フォリント	株式	3銘柄	0.2%	0.3%
ユーロ	株式	11銘柄	0.4%	0.5%

#### (b) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	オフショア・人民元	CHINAAMC ETF SERIES - CH-CNY	2,095,800.00	75,029,640.00	
		オフショア・人民元小計	2,095,800.00	75,029,640.00 (1,545,640,595)	
投資信託受益証券合計				1,545,640,595 (1,545,640,595)	
投資証券	アメリカ・ドル	ISHARES MSCI KUWAIT ETF	59,959.00	1,786,778.20	
		ISHARES MSCI QATAR ETF	118,705.00	2,050,035.35	
		ISHARES MSCI SAUDI ARABIA ETF	240,096.00	9,466,985.28	
		ISHARES MSCI UAE ETF	204,010.00	3,015,267.80	



	アメリカ・ドル小計	622,770.00	16,319,066.63 (2,400,045,129)	
メキシコ・ペソ	CEMEX SAB-CPO	535,300.00	6,445,012.00	
	COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	16,575.00	2,404,203.75	
	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	67,700.00	14,555,500.00	
	GRUPO TELEVISIA SAB-SER CPO	74,700.00	745,506.00	
	TRUST FIBRA UNO	99,100.00	2,706,421.00	
	メキシコ・ペソ小計	793,375.00	26,856,642.75 (228,566,144)	
ブラジル・レアル	BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT	42,700.00	1,481,690.00	
	BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	10,500.00	322,350.00	
	ENERGISA SA-UNITS	6,900.00	359,904.00	
	KLABIN SA - UNIT	23,300.00	545,919.00	
	ブラジル・レアル小計	83,400.00	2,709,863.00 (81,188,036)	
南アフリカ・ランド	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	137,279.00	1,456,530.19	
	南アフリカ・ランド小計	137,279.00	1,456,530.19 (11,433,762)	
投資証券合計			2,721,233,072 (2,721,233,072)	
合計			4,266,873,667 (4,266,873,667)	

(注) 金額欄の( )内は、外貨建有価証券にかかるものの内書きであり、また邦貨換算金額で表示しております。

通貨	銘柄数		組入 投資信託受益証券 時価比率	組入 投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカ・ドル	投資証券	4銘柄	-	6.5%	56.2%
メキシコ・ペソ	投資証券	5銘柄	-	0.6%	5.4%
ブラジル・レアル	投資証券	4銘柄	-	0.2%	1.9%
オフショア・人民元	投資信託受益証券	1銘柄	4.2%	-	36.2%
南アフリカ・ランド	投資証券	1銘柄	-	0.0%	0.3%

#### デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

#### 外国債券パッシブ・マザーファンド

##### (1) 貸借対照表

(単位：円)

	(2022年11月30日現在)	(2023年11月30日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	444,208,536	-
金銭信託	152,609,385	14,780,930
コール・ローン	941,613,352	887,557,200

国債証券	151,679,008,052	168,571,988,349
派生商品評価勘定	-	758,632
未収入金	-	667,860,850
未収利息	973,583,208	1,188,121,174
前払費用	46,285,888	83,396,492
流動資産合計	154,237,308,421	171,414,463,627
資産合計	154,237,308,421	171,414,463,627
負債の部		
流動負債		
未払解約金	27,774,541	85,967,628
その他未払費用	3,600	2,710
流動負債合計	27,778,141	85,970,338
負債合計	27,778,141	85,970,338
純資産の部		
元本等		
元本	77,181,314,549	79,103,510,223
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	77,028,215,731	92,224,983,066
元本等合計	154,209,530,280	171,328,493,289
純資産合計	154,209,530,280	171,328,493,289
負債純資産合計	154,237,308,421	171,414,463,627

## (2) 注記表

## (重要な会計方針の注記)

項目	自 2022年12月1日 至 2023年11月30日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券は個別法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>
3. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	<p>外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。</p>

## （重要な会計上の見積りに関する注記）

会計上の見積りについて、翌計算期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクがある項目を識別していないため、注記を省略しております。

## （貸借対照表に関する注記）

項目	（2022年11月30日現在）	（2023年11月30日現在）
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	77,181,314,549口	79,103,510,223口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.9980円 （1万口当たりの純資産額19,980円）	1口当たり純資産額 2.1659円 （1万口当たりの純資産額21,659円）

## （金融商品に関する注記）

## ・金融商品の状況に関する事項

項目	自 2022年12月1日 至 2023年11月30日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、国債証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 当計算期間については、為替予約取引を行っております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>

<p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p>	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。なお、投資信託協会の流動性リスク管理規制に抵触する場合には、流動性リスクを管理する会議で審議の上、流動性リスクの管理責任者が対処方針を決定します。その後、決定した対処方針やその実施等について、リスク管理会議に報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド(外部ファンド)を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>
--------------------------	--

・金融商品の時価等に関する事項

項目	(2023年11月30日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券(国債証券)</p> <p>「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引)</p> <p>デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。

(デリバティブ取引に関する注記)

(2022年11月30日現在)

該当事項はありません。

(2023年11月30日現在)

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			う ち 1 年 超		
市場取引以外 の取引	為替予約取引 売建				
	オフショア・人民元	83,127,432	-	82,368,800	758,632
	小計	83,127,432	-	82,368,800	758,632
合 計		83,127,432	-	82,368,800	758,632

(注) 1. 時価の算定方法

為替予約取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

1) 計算期間末日に対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。

計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

- ・ 計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、発表されている対顧客先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの対顧客先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

- ・ 計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い受渡日として、発表されている対顧客先物相場の仲値を用いております。

2) 計算期間末日において対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については、計算期間末日の対顧客相場の仲値で評価しております。

3) 上記の算定方法にて、適正な時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認められた価額で評価しております。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

自 2022年12月1日 至 2023年11月30日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

(その他の注記)

(2022年11月30日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	81,104,632,252円
同期中における追加設定元本額	11,875,698,156円
同期中における一部解約元本額	15,799,015,859円
2022年11月30日現在の元本の内訳	
三井住友・DC外国債券インデックスファンドS	25,756,264,406円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	840,993,972円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	2,169,853,266円

三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	1,201,023,285円
S M A M・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	153,754,294円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020(4資産タイプ)	6,205,170円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025(4資産タイプ)	28,041,920円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2030(4資産タイプ)	96,060,756円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2035(4資産タイプ)	254,625,421円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040(4資産タイプ)	182,408,320円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045(4資産タイプ)	295,713,172円
三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型)	22,875,033円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	180,504,559円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	196,065,249円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	127,100,213円
イオン・バランス戦略ファンド	150,083,028円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2050	24,330,578円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	81,016,637円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	61,389,948円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	162,182,842円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	49,154,614円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	24,004,429円
三井住友・DCつみたてN I S A・世界分散ファンド	167,708,487円
三井住友D S・外国債券インデックス年金ファンド	632,445,610円
三井住友D S・年金バランス30(債券重点型)	32,709,599円
三井住友D S・年金バランス50(標準型)	98,399,536円
三井住友D S・年金バランス70(株式重点型)	65,027,461円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2060	3,130,696円
日興F W S・先進国債インデックス(為替ヘッジなし)	766,936,458円
三井住友D S・先進国債インデックス・ファンド	40,133,426円
S M A M・年金外国債券パッシブ・ファンド<適格機関投資家限定>	3,677,884,570円
S M A M・バランスファンドV A安定成長型<適格機関投資家限定>	30,152,077円
S M A M・バランスファンドV A 2 5<適格機関投資家専用>	5,820,669,217円
S M A M・バランスファンドV A 3 7 . 5<適格機関投資家専用>	3,997,274,168円
S M A M・バランスファンドV A 5 0<適格機関投資家専用>	9,331,565,400円
S M A M・バランスファンドV L 3 0<適格機関投資家限定>	30,338,011円
S M A M・バランスファンドV L 5 0<適格機関投資家限定>	75,478,804円
S M A M・バランスファンドV A 7 5<適格機関投資家専用>	631,815,767円
S M A M・バランスファンドV L国際分散型<適格機関投資家限定>	109,386,082円
S M A M・インデックス・バランスV A 2 5<適格機関投資家専用>	949,869,564円
S M A M・インデックス・バランスV A 5 0<適格機関投資家専用>	1,268,921,919円
S M A M・バランスファンドV A 4 0<適格機関投資家専用>	1,336,489,741円
S M A M・バランスファンドV A 3 5<適格機関投資家専用>	4,160,020,552円
S M A M・バランスV A株40T<適格機関投資家限定>	604,716円
S M A M・外国債券パッシブファンドV A<適格機関投資家限定>	7,097,718,053円
三井住友・外国債券インデックスファンド・V A S(適格機関投資家専用)	315,261,191円
S M A M・グローバルバランス40V A<適格機関投資家限定>	122,294,061円
S M A M・アセットバランスファンドV A 2 0 A<適格機関投資家専用>	67,641,422円
S M A M・アセットバランスファンドV A 3 5 A<適格機関投資家専用>	31,256,873円
S M A M・アセットバランスファンドV A 5 0 A<適格機関投資家専用>	11,592,229円
S M A M・アセットバランスファンドV A 2 0 L<適格機関投資家専用>	79,935,071円

SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	365,865,953円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	87,335,608円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	37,410,392円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	5,460,174円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	898,659,693円
SMAM・グローバルバランスファンド(標準型)VA<適格機関投資家限定>	557,262,211円
SMAM・グローバルバランスファンド(債券重視型)VA<適格機関投資家限定>	740,186,895円
SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	424,473,864円
SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定>	280,587,013円
SMAM・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	110,869,714円
SMAM・マルチアセットストラテジーファンド2016-04<適格機関投資家限定>	14,708,323円
SMAM・マルチアセットストラテジー・オープン<適格機関投資家限定>	19,121,369円
SMAM・マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンド<適格機関投資家限定>	623,061,467円
合計	77,181,314,549円

(2023年11月30日現在)

## 開示対象ファンドの

期首における当該親投資信託の元本額	77,181,314,549円
同期中における追加設定元本額	14,383,019,631円
同期中における一部解約元本額	12,460,823,957円

## 2023年11月30日現在の元本の内訳

三井住友・DC外国債券インデックスファンドS	26,901,605,240円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	961,249,247円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	2,399,078,160円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	1,434,433,843円
SMAM・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	164,716,444円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020(4資産タイプ)	5,708,133円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025(4資産タイプ)	25,193,200円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2030(4資産タイプ)	95,498,475円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2035(4資産タイプ)	290,467,200円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040(4資産タイプ)	214,904,326円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045(4資産タイプ)	347,064,911円
三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型)	21,239,858円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	29,533,825円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	66,220,051円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	42,439,096円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	35,495,360円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	348,553,242円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	230,655,022円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	645,740,802円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	198,655,965円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	101,696,493円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	215,034,346円
三井住友DS・外国債券インデックス年金ファンド	985,922,311円
三井住友DS・年金バランス30(債券重点型)	38,234,557円

三井住友D S ・年金バランス50(標準型)	130,547,724円
三井住友D S ・年金バランス70(株式重点型)	92,997,682円
三井住友D S ・DCターゲットイヤーファンド2060	4,212,067円
日興FWS ・先進国債インデックス(為替ヘッジなし)	2,862,282,327円
三井住友D S ・先進国債インデックス・ファンド	262,770,349円
三井住友D S ・DCターゲットイヤーファンド2035	425,346円
三井住友D S ・DCターゲットイヤーファンド2040	311,836円
三井住友D S ・DCターゲットイヤーファンド2045	285,927円
三井住友D S ・DCターゲットイヤーファンド2055	94,319円
三井住友D S ・DCターゲットイヤーファンド2065	160,334円
三井住友D S ・FW専用ポートフォリオ・レベル1(保守型)	617,466円
三井住友D S ・FW専用ポートフォリオ・レベル2(安定型)	7,011,077円
三井住友D S ・FW専用ポートフォリオ・レベル3(安定成長型)	24,243,788円
三井住友D S ・FW専用ポートフォリオ・レベル4(成長型)	11,107,414円
三井住友D S ・FW専用ポートフォリオ・レベル5(積極成長型)	4,028,237円
SMAM ・年金外国債券パッシブ・ファンド<適格機関投資家限定>	4,963,264,998円
SMAM ・バランスファンドVA安定成長型<適格機関投資家限定>	22,646,222円
SMAM ・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	4,372,862,029円
SMAM ・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	3,650,268,785円
SMAM ・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	8,709,472,252円
SMAM ・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	28,565,773円
SMAM ・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	69,008,362円
SMAM ・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	648,783,265円
SMAM ・バランスファンドVL国際分散型<適格機関投資家限定>	103,087,222円
SMAM ・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	877,986,063円
SMAM ・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	1,228,213,127円
SMAM ・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	1,198,338,952円
SMAM ・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	3,669,872,040円
SMAM ・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	604,716円
SMAM ・外国債券パッシブファンドVA<適格機関投資家限定>	6,276,094,571円
三井住友・外国債券インデックスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	313,881,549円
SMAM ・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	101,932,994円
SMAM ・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	56,695,143円
SMAM ・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	29,749,375円
SMAM ・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	11,741,981円
SMAM ・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	64,344,790円
SMAM ・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	334,864,488円
SMAM ・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	72,717,094円
SMAM ・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	37,643,421円
SMAM ・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	5,511,845円
SMAM ・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	792,733,265円
SMAM ・グローバルバランスファンド(標準型)VA<適格機関投資家限定>	480,319,360円
SMAM ・グローバルバランスファンド(債券重視型)VA<適格機関投資家限定>	646,166,262円
SMAM ・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	251,747,031円
SMAM ・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定>	213,172,000円
SMAM ・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	127,692,377円
SMAM ・マルチアセットストラテジーファンド2016-04<適格機関投資家限定>	63,979,919円



SMAM・マルチアセットストラテジー・オープン<適格機関投資家限定>	101,979,254円
SMAM・マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンド <適格機関投資家限定>	282,430,807円
SMDAM・年金Wリスクコントロールファンド(リスク3%)<適格機関投資家限定>	94,702,891円
合計	79,103,510,223円

## (3) 附属明細表

## 有価証券明細表

## (a) 株式

該当事項はありません。

## (b) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	T 0.25 05/31/25	4,400,000.00	4,108,412.00	
		T 0.25 06/30/25	2,900,000.00	2,699,639.00	
		T 0.25 07/31/25	300,000.00	278,382.00	
		T 0.25 09/30/25	2,000,000.00	1,845,260.00	
		T 0.25 10/31/25	1,000,000.00	919,620.00	
		T 0.375 04/30/25	3,000,000.00	2,814,780.00	
		T 0.375 07/31/27	2,500,000.00	2,167,750.00	
		T 0.375 09/30/27	4,800,000.00	4,137,456.00	
		T 0.375 11/30/25	2,000,000.00	1,838,780.00	
		T 0.375 12/31/25	3,000,000.00	2,752,200.00	
		T 0.5 03/31/25	1,600,000.00	1,508,496.00	
		T 0.5 04/30/27	1,200,000.00	1,054,824.00	
		T 0.5 05/31/27	2,500,000.00	2,190,850.00	
		T 0.5 06/30/27	4,000,000.00	3,495,360.00	
		T 0.5 10/31/27	1,000,000.00	863,800.00	
		T 0.625 03/31/27	2,400,000.00	2,124,696.00	
		T 0.625 05/15/30	5,000,000.00	3,976,050.00	
		T 0.625 07/31/26	800,000.00	723,984.00	
		T 0.625 08/15/30	4,800,000.00	3,785,520.00	
		T 0.625 11/30/27	3,400,000.00	2,943,584.00	
		T 0.625 12/31/27	7,200,000.00	6,216,696.00	
		T 0.75 01/31/28	5,900,000.00	5,107,630.00	
		T 0.75 04/30/26	1,500,000.00	1,372,635.00	
		T 0.75 05/31/26	2,000,000.00	1,824,880.00	
		T 0.75 08/31/26	1,500,000.00	1,358,460.00	
		T 0.75 11/15/24	5,200,000.00	4,985,916.00	
		T 0.875 06/30/26	2,000,000.00	1,828,700.00	
		T 0.875 09/30/26	2,500,000.00	2,268,600.00	
		T 0.875 11/15/30	4,900,000.00	3,916,619.00	
		T 1 07/31/28	2,900,000.00	2,501,453.00	
		T 1 12/15/24	4,500,000.00	4,311,945.00	

T 1.125 01/15/25	2,000,000.00	1,914,060.00	
T 1.125 02/15/31	5,700,000.00	4,620,876.00	
T 1.125 02/28/25	1,500,000.00	1,429,830.00	
T 1.125 02/28/27	2,000,000.00	1,807,300.00	
T 1.125 05/15/40	3,800,000.00	2,278,480.00	
T 1.125 08/15/40	3,100,000.00	1,841,834.00	
T 1.125 08/31/28	3,500,000.00	3,030,020.00	
T 1.125 10/31/26	3,700,000.00	3,371,255.00	
T 1.25 05/15/50	5,100,000.00	2,540,922.00	
T 1.25 05/31/28	3,000,000.00	2,631,030.00	
T 1.25 06/30/28	3,000,000.00	2,625,210.00	
T 1.25 08/15/31	5,200,000.00	4,180,384.00	
T 1.25 09/30/28	3,000,000.00	2,607,690.00	
T 1.25 11/30/26	4,200,000.00	3,832,794.00	
T 1.25 12/31/26	2,300,000.00	2,096,542.00	
T 1.375 01/31/25	1,900,000.00	1,821,131.00	
T 1.375 08/15/50	4,500,000.00	2,319,345.00	
T 1.375 08/31/26	600,000.00	552,912.00	
T 1.375 10/31/28	3,000,000.00	2,617,890.00	
T 1.375 11/15/31	4,900,000.00	3,950,527.00	
T 1.375 11/15/40	3,500,000.00	2,165,730.00	
T 1.375 12/31/28	2,500,000.00	2,171,625.00	
T 1.5 01/31/27	4,400,000.00	4,030,444.00	
T 1.5 02/15/25	3,000,000.00	2,876,820.00	
T 1.5 02/15/30	2,100,000.00	1,785,315.00	
T 1.5 10/31/24	1,300,000.00	1,257,191.00	
T 1.5 11/30/24	800,000.00	771,280.00	
T 1.5 11/30/28	2,300,000.00	2,015,858.00	
T 1.625 02/15/26	2,900,000.00	2,722,694.00	
T 1.625 05/15/26	11,450,000.00	10,691,437.50	
T 1.625 05/15/31	5,500,000.00	4,584,305.00	
T 1.625 08/15/29	3,750,000.00	3,260,587.50	
T 1.625 09/30/26	900,000.00	834,219.00	
T 1.625 11/15/50	3,200,000.00	1,766,720.00	
T 1.625 11/30/26	200,000.00	184,640.00	
T 1.75 01/31/29	4,300,000.00	3,801,458.00	
T 1.75 03/15/25	1,500,000.00	1,439,910.00	
T 1.75 08/15/41	4,400,000.00	2,862,376.00	
T 1.75 11/15/29	1,300,000.00	1,133,275.00	
T 1.75 12/31/24	4,000,000.00	3,858,640.00	
T 1.75 12/31/26	2,500,000.00	2,314,500.00	
T 1.875 02/15/32	5,300,000.00	4,424,758.00	
T 1.875 02/15/41	3,300,000.00	2,220,207.00	
T 1.875 02/15/51	5,800,000.00	3,420,724.00	

T 1.875 02/28/27	3,400,000.00	3,145,510.00	
T 1.875 02/28/29	2,800,000.00	2,487,240.00	
T 1.875 07/31/26	2,500,000.00	2,339,150.00	
T 1.875 11/15/51	3,300,000.00	1,938,156.00	
T 2 02/15/25	2,500,000.00	2,411,600.00	
T 2 02/15/50	2,800,000.00	1,715,364.00	
T 2 08/15/25	3,300,000.00	3,151,434.00	
T 2 08/15/51	2,900,000.00	1,760,822.00	
T 2 11/15/26	1,000,000.00	934,120.00	
T 2 11/15/41	3,800,000.00	2,572,980.00	
T 2.125 05/15/25	600,000.00	576,678.00	
T 2.125 11/30/24	2,600,000.00	2,522,624.00	
T 2.25 02/15/27	4,400,000.00	4,125,000.00	
T 2.25 02/15/52	1,700,000.00	1,097,452.00	
T 2.25 03/31/26	8,200,000.00	7,791,722.00	
T 2.25 05/15/41	3,000,000.00	2,142,870.00	
T 2.25 08/15/27	4,200,000.00	3,903,102.00	
T 2.25 08/15/46	1,950,000.00	1,294,000.50	
T 2.25 08/15/49	3,500,000.00	2,279,375.00	
T 2.25 10/31/24	800,000.00	778,968.00	
T 2.25 11/15/24	5,100,000.00	4,959,954.00	
T 2.25 11/15/25	4,000,000.00	3,820,760.00	
T 2.25 11/15/27	4,400,000.00	4,072,024.00	
T 2.25 12/31/24	3,900,000.00	3,782,532.00	
T 2.375 02/15/42	2,800,000.00	2,015,664.00	
T 2.375 03/31/29	5,000,000.00	4,550,450.00	
T 2.375 05/15/27	3,000,000.00	2,811,240.00	
T 2.375 05/15/29	2,400,000.00	2,179,776.00	
T 2.375 05/15/51	3,900,000.00	2,596,737.00	
T 2.375 11/15/49	1,900,000.00	1,272,316.00	
T 2.5 01/31/25	3,400,000.00	3,301,502.00	
T 2.5 02/15/45	1,400,000.00	993,174.00	
T 2.5 02/15/46	1,000,000.00	701,770.00	
T 2.5 02/28/26	2,100,000.00	2,008,524.00	
T 2.5 03/31/27	3,000,000.00	2,830,290.00	
T 2.5 05/15/46	1,000,000.00	699,680.00	
T 2.625 01/31/26	2,200,000.00	2,112,000.00	
T 2.625 02/15/29	1,800,000.00	1,661,976.00	
T 2.625 03/31/25	1,000,000.00	970,010.00	
T 2.625 04/15/25	4,500,000.00	4,362,705.00	
T 2.625 05/31/27	4,800,000.00	4,533,360.00	
T 2.625 07/31/29	1,100,000.00	1,008,645.00	
T 2.625 12/31/25	1,400,000.00	1,345,148.00	
T 2.75 02/15/28	5,300,000.00	4,985,604.00	

T 2.75 02/28/25	2,000,000.00	1,945,620.00	
T 2.75 04/30/27	1,600,000.00	1,519,648.00	
T 2.75 05/15/25	3,000,000.00	2,909,940.00	
T 2.75 05/31/29	1,400,000.00	1,295,518.00	
T 2.75 06/30/25	900,000.00	872,010.00	
T 2.75 08/15/32	4,200,000.00	3,732,414.00	
T 2.75 08/15/42	2,000,000.00	1,526,780.00	
T 2.75 08/15/47	1,800,000.00	1,311,030.00	
T 2.75 08/31/25	3,400,000.00	3,285,624.00	
T 2.75 11/15/42	300,000.00	228,255.00	
T 2.75 11/15/47	1,500,000.00	1,091,880.00	
T 2.875 04/30/25	400,000.00	388,840.00	
T 2.875 04/30/29	3,500,000.00	3,263,785.00	
T 2.875 05/15/28	3,500,000.00	3,300,570.00	
T 2.875 05/15/32	5,700,000.00	5,132,337.00	
T 2.875 05/15/43	1,200,000.00	926,712.00	
T 2.875 05/15/49	1,400,000.00	1,041,544.00	
T 2.875 05/15/52	3,200,000.00	2,379,616.00	
T 2.875 05/31/25	3,100,000.00	3,012,239.00	
T 2.875 06/15/25	2,000,000.00	1,941,820.00	
T 2.875 08/15/28	4,500,000.00	4,232,700.00	
T 2.875 08/15/45	800,000.00	605,008.00	
T 2.875 11/15/46	3,000,000.00	2,249,580.00	
T 2.875 11/30/25	2,500,000.00	2,416,400.00	
T 3 02/15/47	2,500,000.00	1,913,900.00	
T 3 02/15/48	2,400,000.00	1,830,648.00	
T 3 02/15/49	3,300,000.00	2,515,128.00	
T 3 05/15/42	800,000.00	637,528.00	
T 3 05/15/45	900,000.00	697,248.00	
T 3 05/15/47	1,800,000.00	1,376,856.00	
T 3 07/15/25	2,000,000.00	1,944,400.00	
T 3 08/15/48	1,300,000.00	991,094.00	
T 3 08/15/52	3,000,000.00	2,290,950.00	
T 3 09/30/25	1,000,000.00	970,310.00	
T 3 10/31/25	2,600,000.00	2,521,064.00	
T 3 11/15/44	1,000,000.00	777,790.00	
T 3 11/15/45	800,000.00	617,368.00	
T 3.125 02/15/42	1,000,000.00	815,350.00	
T 3.125 02/15/43	2,300,000.00	1,852,972.00	
T 3.125 05/15/48	2,400,000.00	1,873,728.00	
T 3.125 08/15/25	3,000,000.00	2,919,540.00	
T 3.125 08/15/44	1,300,000.00	1,034,657.00	
T 3.125 08/31/29	2,700,000.00	2,540,889.00	
T 3.125 11/15/28	2,900,000.00	2,752,158.00	

T 3.125 11/15/41	1,000,000.00	817,980.00	
T 3.25 05/15/42	2,200,000.00	1,818,520.00	
T 3.25 06/30/29	3,000,000.00	2,846,250.00	
T 3.375 05/15/33	5,500,000.00	5,116,705.00	
T 3.375 05/15/44	500,000.00	415,210.00	
T 3.375 08/15/42	3,000,000.00	2,520,090.00	
T 3.375 11/15/48	3,100,000.00	2,533,010.00	
T 3.5 01/31/28	1,000,000.00	969,960.00	
T 3.5 01/31/30	2,500,000.00	2,393,000.00	
T 3.5 02/15/33	6,100,000.00	5,737,782.00	
T 3.5 02/15/39	200,000.00	178,570.00	
T 3.5 04/30/30	2,500,000.00	2,389,825.00	
T 3.625 02/15/44	300,000.00	259,446.00	
T 3.625 02/15/53	1,700,000.00	1,467,967.00	
T 3.625 03/31/28	3,000,000.00	2,923,230.00	
T 3.625 03/31/30	1,200,000.00	1,155,648.00	
T 3.625 05/15/26	2,500,000.00	2,450,325.00	
T 3.625 05/15/53	2,100,000.00	1,814,694.00	
T 3.625 05/31/28	2,000,000.00	1,948,980.00	
T 3.625 08/15/43	500,000.00	433,775.00	
T 3.75 04/15/26	1,300,000.00	1,277,679.00	
T 3.75 05/31/30	3,000,000.00	2,908,110.00	
T 3.75 06/30/30	4,400,000.00	4,264,128.00	
T 3.75 08/15/41	1,100,000.00	986,942.00	
T 3.75 11/15/43	700,000.00	617,421.00	
T 3.875 01/15/26	5,300,000.00	5,223,786.00	
T 3.875 02/15/43	2,600,000.00	2,342,132.00	
T 3.875 04/30/25	1,000,000.00	985,740.00	
T 3.875 05/15/43	1,500,000.00	1,350,465.00	
T 3.875 08/15/33	5,000,000.00	4,840,600.00	
T 3.875 08/15/40	500,000.00	459,050.00	
T 3.875 09/30/29	2,300,000.00	2,249,998.00	
T 3.875 12/31/27	4,400,000.00	4,330,964.00	
T 3.875 12/31/29	1,500,000.00	1,466,355.00	
T 4 02/15/26	2,000,000.00	1,976,080.00	
T 4 02/28/30	1,500,000.00	1,475,535.00	
T 4 02/29/28	5,000,000.00	4,944,700.00	
T 4 06/30/28	3,000,000.00	2,968,290.00	
T 4 07/31/30	2,200,000.00	2,162,952.00	
T 4 10/31/29	1,600,000.00	1,575,680.00	
T 4 11/15/42	2,000,000.00	1,836,560.00	
T 4 11/15/52	2,600,000.00	2,404,480.00	
T 4.125 01/31/25	3,500,000.00	3,463,005.00	
T 4.125 06/15/26	2,000,000.00	1,983,240.00	

T 4.125 07/31/28	1,000,000.00	994,640.00	
T 4.125 08/15/53	1,000,000.00	946,010.00	
T 4.125 08/31/30	500,000.00	495,035.00	
T 4.125 10/31/27	3,500,000.00	3,476,340.00	
T 4.125 11/15/32	5,600,000.00	5,531,288.00	
T 4.25 05/15/39	100,000.00	97,253.00	
T 4.25 10/15/25	2,000,000.00	1,984,100.00	
T 4.25 11/15/40	600,000.00	576,510.00	
T 4.25 12/31/24	1,500,000.00	1,486,080.00	
T 4.375 05/15/40	900,000.00	881,253.00	
T 4.375 05/15/41	300,000.00	292,206.00	
T 4.375 08/15/26	4,000,000.00	3,992,000.00	
T 4.375 08/15/43	500,000.00	482,500.00	
T 4.375 08/31/28	1,000,000.00	1,005,740.00	
T 4.375 11/15/39	300,000.00	294,876.00	
T 4.5 05/15/38	2,000,000.00	2,017,180.00	
T 4.5 07/15/26	3,900,000.00	3,903,315.00	
T 4.5 08/15/39	300,000.00	299,700.00	
T 4.5 11/15/25	3,800,000.00	3,789,056.00	
T 4.625 02/15/40	1,000,000.00	1,010,740.00	
T 4.625 02/28/25	3,800,000.00	3,782,254.00	
T 4.625 03/15/26	2,500,000.00	2,504,275.00	
T 4.625 09/15/26	4,000,000.00	4,020,280.00	
T 4.625 09/30/30	1,500,000.00	1,529,760.00	
T 4.625 10/15/26	1,000,000.00	1,005,460.00	
T 4.75 02/15/41	900,000.00	918,468.00	
T 5.25 11/15/28	500,000.00	521,600.00	
T 5.375 02/15/31	320,000.00	342,512.00	
T 6 02/15/26	1,000,000.00	1,029,450.00	
T 6.125 11/15/27	1,000,000.00	1,065,270.00	
アメリカ・ドル小計		618,670,000.00	545,175,189.50 (80,178,915,120)
カナダ・ドル	CAN 0.5 09/01/25	2,700,000.00	2,533,167.00
	CAN 1 06/01/27	800,000.00	730,304.00
	CAN 1.25 03/01/27	400,000.00	369,068.00
	CAN 1.25 06/01/30	500,000.00	434,350.00
	CAN 1.5 04/01/25	700,000.00	673,463.00
	CAN 1.5 06/01/26	2,600,000.00	2,452,970.00
	CAN 1.5 12/01/31	2,300,000.00	1,974,757.00
	CAN 1.75 12/01/53	1,100,000.00	770,528.00
	CAN 2 06/01/28	700,000.00	655,249.00
	CAN 2 06/01/32	2,000,000.00	1,775,200.00
	CAN 2.25 06/01/25	500,000.00	485,280.00
	CAN 2.25 06/01/29	1,100,000.00	1,032,273.00

	CAN 2.25 12/01/29	1,000,000.00	934,250.00	
	CAN 2.5 12/01/32	2,930,000.00	2,696,947.80	
	CAN 2.75 06/01/33	1,500,000.00	1,407,375.00	
	CAN 2.75 09/01/27	2,300,000.00	2,222,214.00	
	CAN 2.75 12/01/48	1,300,000.00	1,164,930.00	
	CAN 2.75 12/01/55	200,000.00	176,214.00	
	CAN 3 04/01/26	200,000.00	195,578.00	
	CAN 3 10/01/25	900,000.00	880,902.00	
	CAN 3.5 08/01/25	1,000,000.00	987,290.00	
	CAN 3.5 12/01/45	1,200,000.00	1,216,332.00	
	CAN 4 06/01/41	1,300,000.00	1,392,261.00	
	CAN 4.5 11/01/25	1,800,000.00	1,810,854.00	
	CAN 5 06/01/37	400,000.00	462,040.00	
	CAN 5.75 06/01/29	250,000.00	277,727.50	
	CAN 5.75 06/01/33	300,000.00	353,322.00	
	CANADA 2.75 12/01/64	700,000.00	611,555.00	
	カナダ・ドル小計	32,680,000.00	30,676,401.30 (3,319,493,385)	
オーストラ リア・ドル	ACGB 0.25 11/21/25	1,300,000.00	1,206,075.00	
	ACGB 0.5 09/21/26	100,000.00	90,770.00	
	ACGB 1.25 05/21/32	400,000.00	313,688.00	
	ACGB 1.5 06/21/31	4,400,000.00	3,622,784.00	
	ACGB 1.75 06/21/51	500,000.00	275,680.00	
	ACGB 1.75 11/21/32	1,400,000.00	1,132,614.00	
	ACGB 2.25 05/21/28	1,300,000.00	1,205,594.00	
	ACGB 2.5 05/21/30	2,200,000.00	1,993,068.00	
	ACGB 2.75 06/21/35	800,000.00	680,840.00	
	ACGB 2.75 11/21/27	3,300,000.00	3,147,111.00	
	ACGB 2.75 11/21/28	200,000.00	188,312.00	
	ACGB 2.75 11/21/29	1,800,000.00	1,669,356.00	
	ACGB 3 03/21/47	1,200,000.00	916,668.00	
	ACGB 3 11/21/33	1,000,000.00	890,840.00	
	ACGB 3.25 04/21/25	1,200,000.00	1,184,496.00	
	ACGB 3.25 04/21/29	800,000.00	767,640.00	
	ACGB 3.25 06/21/39	2,000,000.00	1,708,900.00	
	ACGB 3.75 04/21/37	900,000.00	834,246.00	
	ACGB 4.25 04/21/26	2,150,000.00	2,160,621.00	
ACGB 4.5 04/21/33	1,500,000.00	1,517,265.00		
	オーストラリア・ドル小計	28,450,000.00	25,506,568.00 (2,485,615,052)	
シンガポ ール・ドル	SIGB 0.5 11/01/25	200,000.00	189,242.00	
	SIGB 1.25 11/01/26	600,000.00	568,500.00	
	SIGB 1.625 07/01/31	1,000,000.00	911,000.00	
	SIGB 2.25 08/01/36	1,000,000.00	927,000.00	

	SIGB 2.625 05/01/28	800,000.00	789,920.00	
	SIGB 2.75 03/01/46	1,000,000.00	961,000.00	
	SIGB 2.75 04/01/42	700,000.00	675,927.00	
	SIGB 2.875 09/01/30	200,000.00	199,300.00	
	SIGB 3.375 09/01/33	400,000.00	413,788.00	
	SIGB 3.5 03/01/27	1,100,000.00	1,112,870.00	
	シンガポール・ドル小計	7,000,000.00	6,748,547.00 (744,904,618)	
ニュージー ランド・ド ル	NZGB 0.5 05/15/26	100,000.00	89,758.00	
	NZGB 1.75 05/15/41	700,000.00	427,917.00	
	NZGB 2 05/15/32	970,000.00	776,766.30	
	NZGB 2.75 04/15/25	550,000.00	532,097.50	
	NZGB 2.75 05/15/51	500,000.00	327,490.00	
	NZGB 3 04/20/29	1,000,000.00	914,470.00	
	NZGB 4.5 04/15/27	1,100,000.00	1,087,768.00	
	NZGB 4.5 05/15/30	170,000.00	166,654.40	
	ニュージーランド・ドル小計	5,090,000.00	4,322,921.20 (392,088,953)	
イギリス・ ポンド	UK TSY GILT 1.125 01/31/39	400,000.00	254,420.00	
	UKT 0.125 01/30/26	1,300,000.00	1,191,047.00	
	UKT 0.125 01/31/28	1,400,000.00	1,193,542.00	
	UKT 0.25 01/31/25	700,000.00	665,385.00	
	UKT 0.25 07/31/31	1,300,000.00	982,020.00	
	UKT 0.375 10/22/26	1,800,000.00	1,615,590.00	
	UKT 0.375 10/22/30	600,000.00	471,546.00	
	UKT 0.5 01/31/29	2,050,000.00	1,717,695.00	
	UKT 0.5 10/22/61	900,000.00	266,940.00	
	UKT 0.625 06/07/25	900,000.00	849,384.00	
	UKT 0.625 07/31/35	1,900,000.00	1,273,570.00	
	UKT 0.875 07/31/33	1,300,000.00	966,745.00	
	UKT 0.875 10/22/29	500,000.00	420,440.00	
	UKT 1 01/31/32	2,100,000.00	1,660,785.00	
	UKT 1.125 10/22/73	300,000.00	110,160.00	
	UKT 1.25 07/22/27	900,000.00	815,994.00	
	UKT 1.25 07/31/51	1,200,000.00	581,040.00	
	UKT 1.25 10/22/41	2,700,000.00	1,628,370.00	
	UKT 1.5 07/22/26	1,100,000.00	1,026,619.00	
	UKT 1.5 07/22/47	2,000,000.00	1,115,800.00	
	UKT 1.625 10/22/28	300,000.00	269,265.00	
	UKT 1.625 10/22/54	500,000.00	259,750.00	
	UKT 1.75 01/22/49	1,550,000.00	900,860.00	
	UKT 1.75 09/07/37	100,000.00	73,150.00	
UKT 2 09/07/25	1,100,000.00	1,054,174.00		
UKT 2.5 07/22/65	1,600,000.00	1,020,480.00		



	UKT 3.25 01/22/44	1,600,000.00	1,320,160.00	
	UKT 3.25 01/31/33	2,000,000.00	1,873,500.00	
	UKT 3.5 01/22/45	1,250,000.00	1,065,000.00	
	UKT 3.5 07/22/68	1,300,000.00	1,071,720.00	
	UKT 3.5 10/22/25	700,000.00	687,022.00	
	UKT 3.75 01/29/38	800,000.00	744,240.00	
	UKT 3.75 07/22/52	1,200,000.00	1,043,520.00	
	UKT 4 01/22/60	1,300,000.00	1,188,070.00	
	UKT 4.125 01/29/27	1,700,000.00	1,696,107.00	
	UKT 4.25 03/07/36	700,000.00	700,000.00	
	UKT 4.25 06/07/32	500,000.00	509,045.00	
	UKT 4.25 09/07/39	600,000.00	585,342.00	
	UKT 4.25 12/07/27	900,000.00	906,507.00	
	UKT 4.25 12/07/40	600,000.00	581,640.00	
	UKT 4.25 12/07/46	1,500,000.00	1,425,480.00	
	UKT 4.25 12/07/49	900,000.00	852,840.00	
	UKT 4.25 12/07/55	1,700,000.00	1,613,980.00	
	UKT 4.5 09/07/34	400,000.00	411,000.00	
	UKT 4.5 12/07/42	1,050,000.00	1,043,763.00	
	UKT 4.75 12/07/30	1,150,000.00	1,205,683.00	
	UKT 4.75 12/07/38	1,000,000.00	1,036,680.00	
	UKT 5 03/07/25	1,300,000.00	1,304,420.00	
	UKT 6 12/07/28	650,000.00	708,188.00	
	イギリス・ポンド小計	55,300,000.00	45,958,678.00 (8,586,919,398)	
イスラエル・シュケル	ILGOV 0.4 10/31/24	1,800,000.00	1,743,930.00	
	ILGOV 0.5 04/30/25	3,100,000.00	2,960,903.00	
	ILGOV 1 03/31/30	700,000.00	582,995.00	
	ILGOV 1.5 05/31/37	900,000.00	635,112.00	
	ILGOV 2.25 09/28/28	800,000.00	743,408.00	
	ILGOV 3.75 02/28/29	500,000.00	496,230.00	
	ILGOV 3.75 03/31/47	3,600,000.00	3,165,552.00	
	ILGOV 6.25 10/30/26	2,400,000.00	2,561,736.00	
	イスラエル・シュケル小計	13,800,000.00	12,889,866.00 (514,478,378)	
デンマーク・クローネ	DGB 0 11/15/31	500,000.00	409,450.00	
	DGB 0.25 11/15/52	1,800,000.00	910,638.00	
	DGB 0.5 11/15/27	7,800,000.00	7,219,368.00	
	DGB 0.5 11/15/29	5,400,000.00	4,814,802.00	
	DGB 1.75 11/15/25	2,400,000.00	2,351,856.00	
	DGB 2.25 11/15/33	900,000.00	868,032.00	
	DGB 4.5 11/15/39	7,000,000.00	8,490,020.00	
	デンマーク・クローネ小計	25,800,000.00	25,064,166.00 (542,889,836)	

ノル ウェー・ク ローネ	NGB 1.375 08/19/30	6,800,000.00	5,944,628.00	
	NGB 1.5 02/19/26	2,300,000.00	2,185,069.00	
	NGB 1.75 02/17/27	200,000.00	188,162.00	
	NGB 1.75 03/13/25	1,200,000.00	1,165,608.00	
	NGB 1.75 09/06/29	5,000,000.00	4,543,450.00	
	NGB 2 04/26/28	5,900,000.00	5,524,760.00	
	NGB 3 08/15/33	800,000.00	765,920.00	
	NGB 3.5 10/06/42	700,000.00	724,234.00	
ノルウェー・クローネ小計		22,900,000.00	21,041,831.00 (290,587,686)	
スウェーデ ン・クロ ーナ	SGB 0.125 05/12/31	500,000.00	420,290.00	
	SGB 0.75 05/12/28	3,700,000.00	3,427,236.00	
	SGB 0.75 11/12/29	4,200,000.00	3,805,410.00	
	SGB 1 11/12/26	6,200,000.00	5,898,432.00	
	SGB 2.5 05/12/25	5,000,000.00	4,945,750.00	
	SGB 3.5 03/30/39	5,300,000.00	5,830,901.00	
スウェーデン・クローナ小計		24,900,000.00	24,328,019.00 (345,701,150)	
メキシコ・ ペソ	MBONO 10 12/05/24	11,000,000.00	10,904,190.00	
	MBONO 5 03/06/25	12,000,000.00	11,295,600.00	
	MBONO 5.5 03/04/27	3,000,000.00	2,672,220.00	
	MBONO 5.75 03/05/26	19,000,000.00	17,451,690.00	
	MBONO 7.5 05/26/33	6,000,000.00	5,322,360.00	
	MBONO 7.5 06/03/27	21,000,000.00	19,785,360.00	
	MBONO 7.75 05/29/31	29,000,000.00	26,612,720.00	
	MBONO 7.75 11/23/34	18,000,000.00	16,107,660.00	
	MBONO 8 11/07/47	9,000,000.00	7,773,570.00	
	MBONO 8.5 05/31/29	25,000,000.00	24,237,750.00	
	MBONO 8.5 11/18/38	40,000,000.00	37,041,200.00	
メキシコ・ペソ小計		193,000,000.00	179,204,320.00 (1,525,136,286)	
オフショ ア・人民元	CGB 2.18 08/15/26	9,800,000.00	9,723,560.00	
	CGB 2.18 08/25/25	39,000,000.00	38,809,290.00	
	CGB 2.24 05/25/25	31,000,000.00	30,884,370.00	
	CGB 2.26 02/24/25	18,000,000.00	17,938,260.00	
	CGB 2.3 05/15/26	17,000,000.00	16,936,760.00	
	CGB 2.4 07/15/28	41,000,000.00	40,707,260.00	
	CGB 2.46 02/15/26	29,000,000.00	28,995,070.00	
	CGB 2.48 04/15/27	9,000,000.00	8,980,290.00	
	CGB 2.5 07/25/27	16,000,000.00	15,977,920.00	
	CGB 2.52 08/25/33	13,000,000.00	12,799,930.00	
	CGB 2.55 10/15/28	3,000,000.00	2,997,840.00	
	CGB 2.6 09/15/30	7,000,000.00	6,970,600.00	
	CGB 2.62 04/15/28	27,000,000.00	27,075,060.00	

	CGB 2.62 06/25/30	17,000,000.00	16,942,540.00	
	CGB 2.62 09/25/29	19,000,000.00	18,956,300.00	
	CGB 2.64 01/15/28	31,500,000.00	31,635,765.00	
	CGB 2.67 05/25/33	5,000,000.00	4,986,750.00	
	CGB 2.69 08/12/26	50,000,000.00	50,297,500.00	
	CGB 2.8 03/24/29	26,000,000.00	26,203,840.00	
	CGB 2.8 03/25/30	15,000,000.00	15,108,450.00	
	CGB 2.8 11/15/32	21,000,000.00	21,146,790.00	
	CGB 2.88 02/25/33	10,900,000.00	11,082,248.00	
	CGB 2.91 10/14/28	21,000,000.00	21,309,120.00	
	CGB 3.02 05/27/31	43,000,000.00	44,127,460.00	
	CGB 3.12 10/25/52	12,000,000.00	12,105,840.00	
	CGB 3.19 04/15/53	8,000,000.00	8,292,000.00	
	CGB 3.72 04/12/51	38,700,000.00	43,403,985.00	
	オフショア・人民元小計	577,900,000.00	584,394,798.00 (12,038,766,597)	
マレーシ ア・リン ギット	MGS 3.502 05/31/27	5,100,000.00	5,069,910.00	
	MGS 3.582 07/15/32	2,500,000.00	2,434,325.00	
	MGS 3.757 05/22/40	1,400,000.00	1,320,984.00	
	MGS 3.882 03/14/25	500,000.00	503,490.00	
	MGS 3.9 11/30/26	1,300,000.00	1,311,180.00	
	MGS 3.955 09/15/25	3,200,000.00	3,225,728.00	
	MGS 4.498 04/15/30	4,000,000.00	4,142,840.00	
	MGS 4.504 04/30/29	700,000.00	722,421.00	
	MGS 4.696 10/15/42	1,700,000.00	1,809,055.00	
	MGS 4.736 03/15/46	6,700,000.00	7,067,696.00	
	マレーシア・リングギット小計	27,100,000.00	27,607,629.00 (872,174,694)	
ポーラン ド・ズロチ	POLGB 0 10/25/25	5,000,000.00	4,538,250.00	
	POLGB 0.25 10/25/26	7,400,000.00	6,431,266.00	
	POLGB 0.75 04/25/25	1,800,000.00	1,692,126.00	
	POLGB 1.25 10/25/30	7,800,000.00	6,022,614.00	
	POLGB 2.75 04/25/28	2,500,000.00	2,259,525.00	
	POLGB 2.75 10/25/29	700,000.00	612,829.00	
	POLGB 6 10/25/33	2,000,000.00	2,078,540.00	
	ポーランド・ズロチ小計	27,200,000.00	23,635,150.00 (878,854,145)	
ユーロ	BGB 0 10/22/27	800,000.00	721,216.00	
	BGB 0 10/22/31	1,500,000.00	1,197,390.00	
	BGB 0.1 06/22/30	700,000.00	589,148.00	
	BGB 0.35 06/22/32	500,000.00	402,500.00	
	BGB 0.4 06/22/40	800,000.00	496,984.00	
	BGB 0.65 06/22/71	400,000.00	157,320.00	
	BGB 0.8 06/22/25	700,000.00	675,710.00	

BGB 0.8 06/22/27	800,000.00	748,632.00	
BGB 0.8 06/22/28	1,000,000.00	921,180.00	
BGB 0.9 06/22/29	900,000.00	817,695.00	
BGB 1 06/22/26	700,000.00	668,913.00	
BGB 1 06/22/31	1,300,000.00	1,136,967.00	
BGB 1.25 04/22/33	900,000.00	774,864.00	
BGB 1.45 06/22/37	1,200,000.00	961,188.00	
BGB 1.6 06/22/47	650,000.00	450,996.00	
BGB 1.7 06/22/50	1,100,000.00	751,674.00	
BGB 1.9 06/22/38	1,000,000.00	835,120.00	
BGB 2.15 06/22/66	500,000.00	359,080.00	
BGB 2.25 06/22/57	500,000.00	375,285.00	
BGB 3 06/22/34	200,000.00	198,232.00	
BGB 3.75 06/22/45	600,000.00	621,006.00	
BGB 4 03/28/32	300,000.00	323,997.00	
BGB 4.25 03/28/41	900,000.00	995,571.00	
BGB 4.5 03/28/26	1,100,000.00	1,139,710.00	
BGB 5 03/28/35	1,000,000.00	1,172,760.00	
BGB 5.5 03/28/28	1,000,000.00	1,115,020.00	
BKO 3.1 09/18/25	300,000.00	301,005.00	
BTPS 0 08/01/26	1,000,000.00	917,140.00	
BTPS 0 12/15/24	1,300,000.00	1,254,526.00	
BTPS 0.35 02/01/25	2,400,000.00	2,315,496.00	
BTPS 0.45 02/15/29	2,400,000.00	2,052,936.00	
BTPS 0.5 02/01/26	1,000,000.00	941,700.00	
BTPS 0.85 01/15/27	1,500,000.00	1,392,765.00	
BTPS 0.9 04/01/31	2,000,000.00	1,634,540.00	
BTPS 0.95 03/01/37	700,000.00	465,269.00	
BTPS 0.95 06/01/32	3,500,000.00	2,761,360.00	
BTPS 0.95 08/01/30	700,000.00	586,614.00	
BTPS 0.95 09/15/27	800,000.00	732,720.00	
BTPS 0.95 12/01/31	2,600,000.00	2,085,850.00	
BTPS 1.1 04/01/27	3,000,000.00	2,793,870.00	
BTPS 1.25 12/01/26	800,000.00	754,208.00	
BTPS 1.45 03/01/36	400,000.00	293,020.00	
BTPS 1.45 05/15/25	700,000.00	681,261.00	
BTPS 1.45 11/15/24	1,550,000.00	1,519,697.50	
BTPS 1.5 06/01/25	1,900,000.00	1,847,465.00	
BTPS 1.6 06/01/26	1,200,000.00	1,152,300.00	
BTPS 1.65 12/01/30	1,100,000.00	957,913.00	
BTPS 1.7 09/01/51	1,500,000.00	855,570.00	
BTPS 1.85 07/01/25	1,000,000.00	976,300.00	
BTPS 2 02/01/28	2,500,000.00	2,367,575.00	
BTPS 2 12/01/25	1,300,000.00	1,268,046.00	

BTPS 2.05 08/01/27	1,500,000.00	1,434,900.00	
BTPS 2.1 07/15/26	1,000,000.00	970,630.00	
BTPS 2.2 06/01/27	900,000.00	867,438.00	
BTPS 2.25 09/01/36	500,000.00	400,290.00	
BTPS 2.45 09/01/33	600,000.00	524,736.00	
BTPS 2.45 09/01/50	900,000.00	614,511.00	
BTPS 2.5 11/15/25	1,200,000.00	1,182,792.00	
BTPS 2.5 12/01/24	1,300,000.00	1,287,494.00	
BTPS 2.65 12/01/27	400,000.00	389,404.00	
BTPS 2.7 03/01/47	1,250,000.00	926,500.00	
BTPS 2.8 03/01/67	700,000.00	477,547.00	
BTPS 2.8 06/15/29	1,000,000.00	961,270.00	
BTPS 2.8 12/01/28	1,300,000.00	1,261,013.00	
BTPS 2.95 09/01/38	1,000,000.00	843,530.00	
BTPS 3 08/01/29	2,600,000.00	2,526,056.00	
BTPS 3.1 03/01/40	700,000.00	589,519.00	
BTPS 3.25 09/01/46	1,600,000.00	1,308,208.00	
BTPS 3.35 03/01/35	700,000.00	645,008.00	
BTPS 3.45 03/01/48	1,000,000.00	840,410.00	
BTPS 3.5 03/01/30	1,000,000.00	992,510.00	
BTPS 3.7 06/15/30	900,000.00	898,992.00	
BTPS 3.85 09/01/49	1,500,000.00	1,336,515.00	
BTPS 3.85 09/15/26	1,700,000.00	1,724,242.00	
BTPS 3.85 12/15/29	1,300,000.00	1,313,923.00	
BTPS 4 02/01/37	2,600,000.00	2,521,038.00	
BTPS 4 04/30/35	1,100,000.00	1,080,827.00	
BTPS 4.4 05/01/33	800,000.00	824,440.00	
BTPS 4.5 03/01/26	1,300,000.00	1,333,059.00	
BTPS 4.75 09/01/28	1,800,000.00	1,902,690.00	
BTPS 4.75 09/01/44	1,200,000.00	1,227,816.00	
BTPS 5 03/01/25	1,000,000.00	1,017,820.00	
BTPS 5 08/01/34	1,570,000.00	1,682,302.10	
BTPS 5 08/01/39	1,800,000.00	1,904,184.00	
BTPS 5 09/01/40	1,700,000.00	1,797,325.00	
BTPS 5.75 02/01/33	1,700,000.00	1,926,304.00	
BTPS 6 05/01/31	2,200,000.00	2,518,868.00	
BTPS 6.5 11/01/27	1,700,000.00	1,894,208.00	
BTPS 7.25 11/01/26	400,000.00	443,568.00	
DBR 0 02/15/30	1,500,000.00	1,304,250.00	
DBR 0 02/15/32	3,200,000.00	2,647,776.00	
DBR 0 05/15/35	2,900,000.00	2,180,945.00	
DBR 0 05/15/36	800,000.00	583,904.00	
DBR 0 08/15/29	2,500,000.00	2,197,850.00	
DBR 0 08/15/30	1,800,000.00	1,547,316.00	

DBR 0 08/15/31	600,000.00	503,196.00	
DBR 0 08/15/31	2,300,000.00	1,929,746.00	
DBR 0 08/15/50	3,000,000.00	1,505,970.00	
DBR 0 08/15/50	900,000.00	454,230.00	
DBR 0 11/15/27	1,300,000.00	1,184,950.00	
DBR 0 11/15/28	400,000.00	357,376.00	
DBR 0.25 02/15/27	500,000.00	466,165.00	
DBR 0.25 02/15/29	1,400,000.00	1,261,750.00	
DBR 0.25 08/15/28	1,500,000.00	1,363,965.00	
DBR 0.5 02/15/25	2,350,000.00	2,276,421.50	
DBR 0.5 02/15/26	3,200,000.00	3,050,784.00	
DBR 0.5 02/15/28	1,600,000.00	1,483,136.00	
DBR 0.5 08/15/27	2,100,000.00	1,960,749.00	
DBR 1 05/15/38	1,400,000.00	1,127,672.00	
DBR 1 08/15/25	1,900,000.00	1,840,739.00	
DBR 1.25 08/15/48	1,650,000.00	1,236,328.50	
DBR 1.7 08/15/32	2,800,000.00	2,656,248.00	
DBR 1.8 08/15/53	200,000.00	164,834.00	
DBR 1.8 08/15/53	400,000.00	330,420.00	
DBR 2.1 11/15/29	1,400,000.00	1,383,242.00	
DBR 2.3 02/15/33	1,600,000.00	1,588,768.00	
DBR 2.3 02/15/33	500,000.00	496,770.00	
DBR 2.5 07/04/44	1,600,000.00	1,551,392.00	
DBR 2.5 08/15/46	2,700,000.00	2,618,514.00	
DBR 3.25 07/04/42	1,000,000.00	1,079,900.00	
DBR 4 01/04/37	1,300,000.00	1,502,423.00	
DBR 4.25 07/04/39	700,000.00	840,595.00	
DBR 4.75 07/04/28	1,600,000.00	1,766,064.00	
DBR 4.75 07/04/34	600,000.00	727,044.00	
DBR 4.75 07/04/40	1,450,000.00	1,850,751.00	
DBR 5.5 01/04/31	900,000.00	1,084,680.00	
DBR 5.625 01/04/28	1,000,000.00	1,125,010.00	
DBR 6.25 01/04/30	800,000.00	977,552.00	
DBR 6.5 07/04/27	1,000,000.00	1,135,890.00	
FRTR 0 02/25/25	3,000,000.00	2,884,410.00	
FRTR 0 02/25/26	3,800,000.00	3,568,618.00	
FRTR 0 02/25/27	1,100,000.00	1,008,062.00	
FRTR 0 03/25/25	1,900,000.00	1,822,936.00	
FRTR 0 05/25/32	2,900,000.00	2,283,692.00	
FRTR 0 11/25/29	4,500,000.00	3,836,700.00	
FRTR 0 11/25/30	3,900,000.00	3,224,091.00	
FRTR 0 11/25/31	3,000,000.00	2,402,460.00	
FRTR 0.25 11/25/26	2,900,000.00	2,694,013.00	
FRTR 0.5 05/25/25	1,300,000.00	1,251,796.00	

FRTR 0.5 05/25/26	3,300,000.00	3,118,665.00	
FRTR 0.5 05/25/29	3,000,000.00	2,668,590.00	
FRTR 0.5 05/25/40	1,300,000.00	838,370.00	
FRTR 0.5 05/25/72	100,000.00	36,023.00	
FRTR 0.5 06/25/44	1,200,000.00	691,092.00	
FRTR 0.75 02/25/28	3,200,000.00	2,953,792.00	
FRTR 0.75 05/25/28	3,100,000.00	2,849,613.00	
FRTR 0.75 05/25/52	3,000,000.00	1,543,260.00	
FRTR 0.75 11/25/28	3,100,000.00	2,824,317.00	
FRTR 1 05/25/27	2,200,000.00	2,075,612.00	
FRTR 1 11/25/25	1,500,000.00	1,445,310.00	
FRTR 1.25 05/25/34	1,200,000.00	1,010,940.00	
FRTR 1.25 05/25/36	2,750,000.00	2,213,310.00	
FRTR 1.25 05/25/38	900,000.00	691,542.00	
FRTR 1.5 05/25/31	3,050,000.00	2,791,207.50	
FRTR 1.5 05/25/50	2,400,000.00	1,592,976.00	
FRTR 1.75 05/25/66	800,000.00	514,008.00	
FRTR 1.75 06/25/39	2,700,000.00	2,210,949.00	
FRTR 1.75 11/25/24	800,000.00	786,944.00	
FRTR 2 05/25/48	2,000,000.00	1,525,620.00	
FRTR 2 11/25/32	3,000,000.00	2,790,090.00	
FRTR 2.5 05/25/30	2,600,000.00	2,565,576.00	
FRTR 2.5 05/25/43	900,000.00	783,153.00	
FRTR 2.5 09/24/26	1,900,000.00	1,883,926.00	
FRTR 2.75 02/25/29	1,100,000.00	1,101,353.00	
FRTR 2.75 10/25/27	2,650,000.00	2,654,876.00	
FRTR 3 05/25/33	1,500,000.00	1,507,380.00	
FRTR 3.25 05/25/45	900,000.00	877,671.00	
FRTR 3.5 04/25/26	1,800,000.00	1,827,180.00	
FRTR 4 04/25/55	1,370,000.00	1,494,190.50	
FRTR 4 04/25/60	1,400,000.00	1,540,504.00	
FRTR 4 10/25/38	2,000,000.00	2,174,580.00	
FRTR 4.5 04/25/41	1,900,000.00	2,190,434.00	
FRTR 4.75 04/25/35	800,000.00	926,800.00	
FRTR 5.5 04/25/29	1,650,000.00	1,877,073.00	
FRTR 5.75 10/25/32	400,000.00	488,508.00	
FRTR 6 10/25/25	2,100,000.00	2,217,348.00	
IRISH 0 10/18/31	500,000.00	404,170.00	
IRISH 0.9 05/15/28	500,000.00	464,235.00	
IRISH 1 05/15/26	800,000.00	766,984.00	
IRISH 1.1 05/15/29	500,000.00	460,710.00	
IRISH 1.3 05/15/33	500,000.00	436,830.00	
IRISH 1.35 03/18/31	500,000.00	455,485.00	
IRISH 1.5 05/15/50	500,000.00	339,295.00	

IRISH 1.7 05/15/37	300,000.00	253,227.00	
IRISH 2 02/18/45	1,100,000.00	879,131.00	
IRISH 2.4 05/15/30	600,000.00	589,272.00	
IRISH 5.4 03/13/25	800,000.00	822,752.00	
NETHER 0 01/15/27	1,300,000.00	1,198,366.00	
NETHER 0 07/15/30	2,200,000.00	1,857,130.00	
NETHER 0.25 07/15/25	1,300,000.00	1,244,867.00	
NETHER 0.25 07/15/29	500,000.00	440,195.00	
NETHER 0.5 01/15/40	1,500,000.00	1,040,250.00	
NETHER 0.5 07/15/26	1,300,000.00	1,227,863.00	
NETHER 0.5 07/15/32	1,700,000.00	1,417,205.00	
NETHER 0.75 07/15/27	400,000.00	374,780.00	
NETHER 0.75 07/15/28	1,500,000.00	1,382,595.00	
NETHER 2.5 01/15/33	600,000.00	589,884.00	
NETHER 2.5 07/15/33	500,000.00	489,400.00	
NETHER 2.75 01/15/47	2,200,000.00	2,147,222.00	
NETHER 3.75 01/15/42	1,300,000.00	1,447,160.00	
NETHER 4 01/15/37	300,000.00	335,988.00	
NETHER 5.5 01/15/28	700,000.00	778,078.00	
OBL 0 04/10/26	2,100,000.00	1,974,651.00	
OBL 0 04/11/25	2,800,000.00	2,687,104.00	
OBL 0 04/16/27	3,200,000.00	2,947,712.00	
OBL 0 10/09/26	1,000,000.00	930,620.00	
OBL 0 10/10/25	2,600,000.00	2,469,194.00	
OBL 1.3 10/15/27	300,000.00	288,132.00	
OBL 2.2 04/13/28	600,000.00	595,758.00	
OBL 2.4 10/19/28	700,000.00	701,393.00	
RAGB 0 02/20/30	1,300,000.00	1,093,885.00	
RAGB 0 02/20/31	1,400,000.00	1,141,112.00	
RAGB 0 04/20/25	300,000.00	287,532.00	
RAGB 0.5 02/20/29	550,000.00	490,517.50	
RAGB 0.5 04/20/27	700,000.00	649,544.00	
RAGB 0.75 02/20/28	600,000.00	553,404.00	
RAGB 0.75 03/20/51	900,000.00	498,465.00	
RAGB 0.75 10/20/26	600,000.00	566,334.00	
RAGB 0.85 06/30/20	250,000.00	107,257.50	
RAGB 0.9 02/20/32	1,000,000.00	853,510.00	
RAGB 1.2 10/20/25	1,000,000.00	968,570.00	
RAGB 1.5 02/20/47	700,000.00	499,688.00	
RAGB 1.5 11/02/86	400,000.00	226,412.00	
RAGB 2.4 05/23/34	1,000,000.00	944,500.00	
RAGB 3.15 06/20/44	500,000.00	492,400.00	
RAGB 3.8 01/26/62	700,000.00	775,698.00	
RAGB 4.15 03/15/37	300,000.00	330,825.00	



RAGB 4.85 03/15/26	800,000.00	834,288.00	
RAGB 6.25 07/15/27	1,000,000.00	1,119,180.00	
RFGB 0 09/15/26	300,000.00	277,821.00	
RFGB 0 09/15/30	400,000.00	331,900.00	
RFGB 0.25 09/15/40	500,000.00	309,360.00	
RFGB 0.5 04/15/26	700,000.00	663,719.00	
RFGB 0.5 09/15/27	500,000.00	461,485.00	
RFGB 0.5 09/15/28	300,000.00	270,657.00	
RFGB 0.5 09/15/29	800,000.00	706,192.00	
RFGB 0.75 04/15/31	800,000.00	691,552.00	
RFGB 1.375 04/15/47	500,000.00	352,960.00	
RFGB 2.625 07/04/42	800,000.00	734,376.00	
RFGB 2.75 07/04/28	200,000.00	200,750.00	
RFGB 4 07/04/25	300,000.00	304,242.00	
SPGB 0 01/31/25	500,000.00	480,920.00	
SPGB 0 05/31/25	2,600,000.00	2,477,514.00	
SPGB 0.5 04/30/30	1,600,000.00	1,361,824.00	
SPGB 0.5 10/31/31	1,400,000.00	1,137,388.00	
SPGB 0.7 04/30/32	2,200,000.00	1,791,064.00	
SPGB 0.8 07/30/27	1,700,000.00	1,573,010.00	
SPGB 0.8 07/30/29	700,000.00	618,723.00	
SPGB 0.85 07/30/37	800,000.00	556,624.00	
SPGB 1 10/31/50	800,000.00	410,672.00	
SPGB 1.2 10/31/40	1,400,000.00	940,884.00	
SPGB 1.25 10/31/30	1,800,000.00	1,591,380.00	
SPGB 1.3 10/31/26	2,400,000.00	2,288,136.00	
SPGB 1.4 04/30/28	2,000,000.00	1,870,800.00	
SPGB 1.4 07/30/28	1,200,000.00	1,118,580.00	
SPGB 1.45 04/30/29	2,100,000.00	1,937,250.00	
SPGB 1.45 10/31/27	1,800,000.00	1,700,190.00	
SPGB 1.45 10/31/71	400,000.00	182,264.00	
SPGB 1.5 04/30/27	1,500,000.00	1,428,585.00	
SPGB 1.6 04/30/25	1,400,000.00	1,367,352.00	
SPGB 1.85 07/30/35	1,600,000.00	1,342,832.00	
SPGB 1.95 04/30/26	2,400,000.00	2,339,448.00	
SPGB 1.95 07/30/30	700,000.00	651,728.00	
SPGB 2.15 10/31/25	1,600,000.00	1,573,488.00	
SPGB 2.35 07/30/33	700,000.00	641,382.00	
SPGB 2.55 10/31/32	1,600,000.00	1,506,864.00	
SPGB 2.7 10/31/48	750,000.00	598,095.00	
SPGB 2.75 10/31/24	1,000,000.00	992,610.00	
SPGB 2.8 05/31/26	1,100,000.00	1,093,180.00	
SPGB 2.9 10/31/46	1,700,000.00	1,430,652.00	
SPGB 3.15 04/30/33	1,500,000.00	1,473,105.00	

	SPGB 3.45 07/30/66	1,300,000.00	1,120,275.00	
	SPGB 3.9 07/30/39	200,000.00	201,268.00	
	SPGB 4.2 01/31/37	1,050,000.00	1,109,871.00	
	SPGB 4.65 07/30/25	800,000.00	818,544.00	
	SPGB 4.7 07/30/41	1,500,000.00	1,661,985.00	
	SPGB 4.9 07/30/40	1,400,000.00	1,576,680.00	
	SPGB 5.15 10/31/28	1,500,000.00	1,646,070.00	
	SPGB 5.15 10/31/44	1,400,000.00	1,641,150.00	
	SPGB 5.75 07/30/32	1,000,000.00	1,185,700.00	
	SPGB 5.9 07/30/26	500,000.00	535,820.00	
	SPGB 6 01/31/29	1,900,000.00	2,169,097.00	
	ユーロ小計	376,640,000.00	345,832,846.60 (55,855,463,054)	
国債証券合計			168,571,988,349 (168,571,988,349)	
合 計			168,571,988,349 (168,571,988,349)	

(注) 金額欄の( )内は、外貨建有価証券にかかるものの内書きであり、また邦貨換算金額で表示しております。

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカ・ドル	国債証券 237銘柄	46.8%	47.6%
カナダ・ドル	国債証券 28銘柄	1.9%	2.0%
オーストラリア・ドル	国債証券 20銘柄	1.5%	1.5%
シンガポール・ドル	国債証券 10銘柄	0.4%	0.4%
ニュージーランド・ドル	国債証券 8銘柄	0.2%	0.2%
イギリス・ポンド	国債証券 49銘柄	5.0%	5.1%
イスラエル・シェケル	国債証券 8銘柄	0.3%	0.3%
デンマーク・クローネ	国債証券 7銘柄	0.3%	0.3%
ノルウェー・クローネ	国債証券 8銘柄	0.2%	0.2%
スウェーデン・クローナ	国債証券 6銘柄	0.2%	0.2%
メキシコ・ペソ	国債証券 11銘柄	0.9%	0.9%
オフショア・人民元	国債証券 27銘柄	7.0%	7.1%
マレーシア・リンギット	国債証券 10銘柄	0.5%	0.5%
ポーランド・ズロチ	国債証券 7銘柄	0.5%	0.5%
ユーロ	国債証券 282銘柄	32.6%	33.1%

#### デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

#### 米ドル建て新興国債インデックス・マザーファンド

##### (1) 貸借対照表

(単位：円)

	(2022年11月30日現在)	(2023年11月30日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	78,573,387	176,054,609
金銭信託	2,587,805	304,620

コール・ローン	15,966,983	18,291,626
国債証券	2,894,688,630	6,320,353,546
派生商品評価勘定	21,511	-
未収利息	25,080,637	66,275,690
前払費用	6,190,809	15,724,480
流動資産合計	3,023,109,762	6,597,004,571
資産合計	3,023,109,762	6,597,004,571
負債の部		
流動負債		
未払金	-	128,642,129
未払解約金	-	13,829,456
その他未払費用	59	39
流動負債合計	59	142,471,624
負債合計	59	142,471,624
純資産の部		
元本等		
元本	3,247,890,526	6,292,053,335
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	224,780,823	162,479,612
元本等合計	3,023,109,703	6,454,532,947
純資産合計	3,023,109,703	6,454,532,947
負債純資産合計	3,023,109,762	6,597,004,571

## (2) 注記表

## (重要な会計方針の注記)

項目	自 2022年12月1日 至 2023年11月30日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券は個別法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>
3. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	<p>外貨建資産等の会計処理</p> <p>「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。</p>

## （重要な会計上の見積りに関する注記）

会計上の見積りについて、翌計算期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクがある項目を識別していないため、注記を省略しております。

## （貸借対照表に関する注記）

項目	（2022年11月30日現在）	（2023年11月30日現在）
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	3,247,890,526口	6,292,053,335口
2. 「投資信託財産の計算に関する規則」第55条の6第10号に規定する額	元本の欠損 224,780,823円	元本の欠損
3. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 0.9308円 （1万口当たりの純資産額9,308円）	1口当たり純資産額 1.0258円 （1万口当たりの純資産額10,258円）

## （金融商品に関する注記）

## ・金融商品の状況に関する事項

項目	自 2022年12月1日 至 2023年11月30日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、国債証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。 当計算期間については、為替予約取引を行っております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>

<p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p>	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。なお、投資信託協会の流動性リスク管理規制に抵触する場合には、流動性リスクを管理する会議で審議の上、流動性リスクの管理責任者が対処方針を決定します。その後、決定した対処方針やその実施等について、リスク管理会議に報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>
--------------------------	--

・金融商品の時価等に関する事項

項目	(2023年11月30日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（国債証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。

(デリバティブ取引に関する注記)

(2022年11月30日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			う ち 1 年 超		
市場取引以外 の取引	為替予約取引 買建				
	アメリカ・ドル	9,698,080	-	9,719,591	21,511
	小計	9,698,080	-	9,719,591	21,511
合 計		9,698,080	-	9,719,591	21,511

## (注) 1. 時価の算定方法

為替予約取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

- 1) 計算期間末日に対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。

計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

- ・ 計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、発表されている対顧客先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの対顧客先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。
- ・ 計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い受渡日として、発表されている対顧客先物相場の仲値を用いております。

- 2) 計算期間末日において対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については、計算期間末日の対顧客相場の仲値で評価しております。

- 3) 上記の算定方法にて、適正な時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認められた価額で評価しております。

## 2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(2023年11月30日現在)

該当事項はありません。

## (関連当事者との取引に関する注記)

自 2022年12月1日 至 2023年11月30日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

## (その他の注記)

(2022年11月30日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	1,047,048,040円
同期中における追加設定元本額	2,892,281,882円
同期中における一部解約元本額	691,439,396円
2022年11月30日現在の元本の内訳	
日興FWS・新興国債インデックス(為替ヘッジあり)	391,617,618円
日興FWS・新興国債インデックス(為替ヘッジなし)	1,945,147,099円

三井住友D S ・新興国債インデックス・ファンド	12,227,737円
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	176,545,209円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	425,820,622円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	296,532,241円
合 計	3,247,890,526円

(2023年11月30日現在)

開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	3,247,890,526円
同期中における追加設定元本額	3,462,192,075円
同期中における一部解約元本額	418,029,266円
2023年11月30日現在の元本の内訳	
日興FWS・新興国債インデックス（為替ヘッジあり）	376,043,484円
日興FWS・新興国債インデックス（為替ヘッジなし）	4,964,440,534円
三井住友D S ・新興国債インデックス・ファンド	33,428,583円
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	152,145,037円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	380,431,542円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	248,569,506円
三井住友D S ・DCターゲットイヤーファンド2050	44,360,570円
三井住友D S ・DCターゲットイヤーファンド2060	5,217,027円
三井住友D S ・DCターゲットイヤーファンド2035	540,499円
三井住友D S ・DCターゲットイヤーファンド2040	386,018円
三井住友D S ・DCターゲットイヤーファンド2045	349,704円
三井住友D S ・DCターゲットイヤーファンド2055	118,064円
三井住友D S ・DCターゲットイヤーファンド2065	199,628円
三井住友D S ・FW専用ポートフォリオ・レベル1（保守型）	203,853円
三井住友D S ・FW専用ポートフォリオ・レベル2（安定型）	7,186,266円
三井住友D S ・FW専用ポートフォリオ・レベル3（安定成長型）	39,657,321円
三井住友D S ・FW専用ポートフォリオ・レベル4（成長型）	26,205,377円
三井住友D S ・FW専用ポートフォリオ・レベル5（積極成長型）	12,570,322円
合 計	6,292,053,335円

## (3) 附属明細表

## 有価証券明細表

## (a) 株式

該当事項はありません。

## (b) 株式以外の有価証券

種 類	通 貨	銘 柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	ADGB 1.875 09/15/31	1,700,000.00	1,393,728.00	
		ADGB 2.5 04/16/25	700,000.00	674,471.00	
		ADGB 3.125 04/16/30	400,000.00	366,348.00	
		ADGB 3.125 09/30/49	1,000,000.00	674,290.00	
		ADGB 3.875 04/16/50	200,000.00	154,596.00	
		BRAZIL 2.875 06/06/25	600,000.00	576,600.00	
		BRAZIL 3.75 09/12/31	600,000.00	526,146.00	

BRAZIL 3.875 06/12/30	500,000.00	448,925.00	
BRAZIL 4.75 01/14/50	700,000.00	511,735.00	
BRAZIL 5.625 01/07/41	200,000.00	175,384.00	
BRAZIL 6 10/20/33	900,000.00	881,595.00	
BRAZIL 6.25 03/18/31	300,000.00	305,520.00	
CHILE 2.55 07/27/33	800,000.00	640,496.00	
CHILE 2.75 01/31/27	400,000.00	373,756.00	
CHILE 3.1 05/07/41	200,000.00	143,870.00	
CHILE 3.5 01/25/50	600,000.00	427,764.00	
CHILE 3.5 01/31/34	200,000.00	172,588.00	
CHILE 4.34 03/07/42	600,000.00	510,240.00	
CHILE 4.95 01/05/36	600,000.00	573,828.00	
CHINA (PEOPLE'S) 1.2 10/21/30	700,000.00	574,931.00	
CHINA 0.55 10/21/25	200,000.00	184,960.00	
CHINA 1.25 10/26/26	700,000.00	637,602.00	
COLOM 3.125 04/15/31	800,000.00	622,024.00	
COLOM 7.5 02/02/34	1,400,000.00	1,404,690.00	
COLOM 8 04/20/33	800,000.00	833,728.00	
DOMREP 5.5 02/22/29	500,000.00	473,455.00	
DOMREP 5.875 01/30/60	900,000.00	726,750.00	
DOMREP 6 02/22/33	1,700,000.00	1,587,273.00	
INDON 3.05 03/12/51	200,000.00	136,386.00	
INDON 3.85 10/15/30	400,000.00	372,000.00	
INDON 4.2 10/15/50	200,000.00	164,270.00	
INDON 4.75 01/08/26	400,000.00	396,828.00	
INDON 5.125 01/15/45	400,000.00	377,916.00	
KSA 2.25 02/02/33	1,600,000.00	1,271,920.00	
KSA 3.625 03/04/28	600,000.00	571,956.00	
KSA 4.75 01/18/28	600,000.00	596,946.00	
KSA 4.875 07/18/33	700,000.00	687,008.00	
KSA 5 01/18/53	800,000.00	688,248.00	
KSA 5.25 01/16/50	200,000.00	180,188.00	
MEX 2.659 05/24/31	1,200,000.00	987,336.00	
MEX 3.25 04/16/30	200,000.00	176,668.00	
MEX 4.5 01/31/50	300,000.00	231,324.00	
MEX 4.5 04/22/29	200,000.00	192,764.00	
MEX 4.875 05/19/33	400,000.00	373,296.00	
MEX 5 04/27/51	900,000.00	739,332.00	
MEX 6.338 05/04/53	900,000.00	863,991.00	
MEX 6.35 02/09/35	500,000.00	507,580.00	
OMAN 6 08/01/29	600,000.00	609,660.00	
OMAN 6.25 01/25/31	1,200,000.00	1,235,892.00	
PANAMA 2.252 09/29/32	800,000.00	563,216.00	



PANAMA 4.5 01/19/63	800,000.00	497,144.00	
PANAMA 6.4 02/14/35	900,000.00	842,517.00	
PERU 2.783 01/23/31	1,000,000.00	843,630.00	
PERU 3 01/15/34	200,000.00	161,124.00	
PERU 5.625 11/18/50	800,000.00	773,688.00	
PHILIP 1.648 06/10/31	200,000.00	156,962.00	
PHILIP 2.65 12/10/45	400,000.00	256,496.00	
PHILIP 2.95 05/05/45	200,000.00	134,430.00	
PHILIP 3.7 02/02/42	200,000.00	155,744.00	
QATAR 3.4 04/16/25	400,000.00	390,232.00	
QATAR 3.75 04/16/30	1,400,000.00	1,329,734.00	
QATAR 4.4 04/16/50	1,300,000.00	1,090,934.00	
REPHUN 5.25 06/16/29	500,000.00	489,440.00	
REPHUN 6.25 09/22/32	900,000.00	921,213.00	
SOAF 4.85 09/30/29	600,000.00	540,672.00	
SOAF 7.3 04/20/52	900,000.00	781,146.00	
TURKEY 6.125 10/24/28	800,000.00	757,624.00	
TURKEY 6.375 10/14/25	400,000.00	397,268.00	
TURKEY 9.125 07/13/30	900,000.00	947,430.00	
TURKEY 9.375 01/19/33	600,000.00	641,262.00	
TURKEY 9.875 01/15/28	1,200,000.00	1,295,712.00	
URUGUA 4.375 01/23/31	400,000.00	388,884.00	
URUGUA 4.975 04/20/55	400,000.00	365,824.00	
URUGUA 5.75 10/28/34	300,000.00	314,010.00	
アメリカ・ドル小計	47,900,000.00	42,975,138.00 (6,320,353,546)	
国債証券合計		6,320,353,546 (6,320,353,546)	
合計		6,320,353,546 (6,320,353,546)	

(注) 金額欄の( )内は、外貨建有価証券にかかるものの内書きであり、また邦貨換算金額で表示しております。

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカ・ドル	国債証券 74銘柄	97.9%	100.0%

#### デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

#### Jリート・インデックス・マザーファンド

##### (1) 貸借対照表

(単位：円)

	(2022年11月30日現在)	(2023年11月30日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	16,783,253	15,673,678

コール・ローン	103,554,152	941,164,412
投資証券	10,443,009,900	12,637,122,100
未収入金	-	88,703,025
未収配当金	61,307,439	82,039,619
前払金	592,000	1,264,000
差入委託証拠金	2,300,000	2,042,045
流動資産合計	10,627,546,744	13,768,008,879
資産合計	10,627,546,744	13,768,008,879
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	746,400	868,400
未払金	60,516,485	-
未払解約金	2,127,632	1,001,023,568
その他未払費用	441	174
流動負債合計	63,390,958	1,001,892,142
負債合計	63,390,958	1,001,892,142
純資産の部		
元本等		
元本	3,913,179,470	4,830,612,947
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	6,650,976,316	7,935,503,790
元本等合計	10,564,155,786	12,766,116,737
純資産合計	10,564,155,786	12,766,116,737
負債純資産合計	10,627,546,744	13,768,008,879

## (2) 注記表

## (重要な会計方針の注記)

項目	自 2022年12月1日 至 2023年11月30日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場によっております。</p>

## （重要な会計上の見積りに関する注記）

会計上の見積りについて、翌計算期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクがある項目を識別していないため、注記を省略しております。

## （貸借対照表に関する注記）

項目	（2022年11月30日現在）	（2023年11月30日現在）
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	3,913,179,470口	4,830,612,947口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 2.6996円 （1万口当たりの純資産額26,996円）	1口当たり純資産額 2.6428円 （1万口当たりの純資産額26,428円）

## （金融商品に関する注記）

## . 金融商品の状況に関する事項

項目	自 2022年12月1日 至 2023年11月30日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券</p> <p>当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、投資証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引</p> <p>当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。</p> <p>当計算期間については、先物取引を行っております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク</p> <p>有価証券およびデリバティブ取引等</p> <p>当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>

<p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p>	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。なお、投資信託協会の流動性リスク管理規制に抵触する場合には、流動性リスクを管理する会議で審議の上、流動性リスクの管理責任者が対処方針を決定します。その後、決定した対処方針やその実施等について、リスク管理会議に報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>
--------------------------	--

・金融商品の時価等に関する事項

項目	(2023年11月30日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（投資証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。

(デリバティブ取引に関する注記)

(2022年11月30日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち 1年超		
市場取引	リート指数先物取引 買建				
	TREIT先物 0412月	40,146,400	-	39,400,000	746,400
	小計	40,146,400	-	39,400,000	746,400
合計		40,146,400	-	39,400,000	746,400

(2023年11月30日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位:円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち 1年超		
市場取引	リート指数先物取引 買建				
	TREIT先物 0512月	37,778,400	-	36,910,000	868,400
	小計	37,778,400	-	36,910,000	868,400
合計		37,778,400	-	36,910,000	868,400

(注) 1. 時価の算定方法

リート指数先物取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

1) 原則として計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しております。

このような時価が発表されていない場合には、計算期間末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

2) リート指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

自 2022年12月1日 至 2023年11月30日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

(その他の注記)

(2022年11月30日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	3,284,744,165円
同期中における追加設定元本額	2,347,844,703円
同期中における一部解約元本額	1,719,409,398円
2022年11月30日現在の元本の内訳	
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	123,734,117円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	226,924,020円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	145,809,464円

イオン・バランス戦略ファンド	20,352,708円
三井住友・DC日本リートインデックスファンド	2,243,436,891円
三井住友D S ・DCターゲットイヤーファンド2050	18,736,291円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	60,011,376円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	46,032,543円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	162,453,627円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	92,074,182円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	72,660,790円
三井住友・DCつみたてN I S A ・世界分散ファンド	30,209,555円
三井住友D S ・DCターゲットイヤーファンド2060	2,455,740円
三井住友D S ・国内リートインデックス年金ファンド	167,299,338円
日興F W S ・Jリートインデックス	374,896,546円
三井住友D S ・国内リートインデックス・ファンド	43,763,199円
S M A M ・世界リート・インデックスファンドV A <適格機関投資家限定>	3,324,665円
S M A M ・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	28,778,069円
S M A M ・マルチアセットストラテジーファンド2016-04<適格機関投資家限定>	3,208,159円
S M A M ・マルチアセットストラテジー・オープン<適格機関投資家限定>	4,273,982円
S M D A M ・リスクコントロール型バランスファンド202105(リスク3%) <適格機関投資家限定>	42,744,208円
合計	3,913,179,470円

(2023年11月30日現在)

開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	3,913,179,470円
同期中における追加設定元本額	2,661,487,379円
同期中における一部解約元本額	1,744,053,902円
2023年11月30日現在の元本の内訳	
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	59,744,253円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	107,345,540円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	91,815,945円
イオン・バランス戦略ファンド	44,888,235円
三井住友・DC日本リートインデックスファンド	2,606,199,097円
三井住友D S ・DCターゲットイヤーファンド2050	20,980,647円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	39,830,330円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	41,785,178円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	177,457,697円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	108,030,717円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	83,650,123円
三井住友・DCつみたてN I S A ・世界分散ファンド	42,875,067円
三井住友D S ・DCターゲットイヤーファンド2060	2,481,479円
三井住友D S ・国内リートインデックス年金ファンド	245,590,078円
日興F W S ・Jリートインデックス	732,374,533円
三井住友D S ・国内リートインデックス・ファンド	54,236,752円
三井住友D S ・DCターゲットイヤーファンド2035	172,642円
三井住友D S ・DCターゲットイヤーファンド2040	136,694円
三井住友D S ・DCターゲットイヤーファンド2045	151,353円

三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2055	56,144円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2065	95,002円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル1(保守型)	237,890円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル2(安定型)	6,626,152円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル3(安定成長型)	33,319,844円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル4(成長型)	20,849,098円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル5(積極成長型)	9,707,734円
SMAM・世界リート・インデックスファンドVA<適格機関投資家限定>	3,102,704円
SMAM・年金WRリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	82,552,941円
SMAM・マルチアセットストラテジーファンド2016-04<適格機関投資家限定>	53,450,402円
SMAM・マルチアセットストラテジー・オープン<適格機関投資家限定>	85,458,199円
SMDAM・リスクコントロール型バランスファンド202105(リスク3%) <適格機関投資家限定>	75,410,477円
合計	4,830,612,947円

## (3) 附属明細表

## 有価証券明細表

## (a) 株式

該当事項はありません。

## (b) 株式以外の有価証券

(単位:円)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	エスコンジャパンリート投資法人	241	28,534,400	
	サンケイリアルエステート投資法人	379	35,133,300	
	SOSILA物流リート投資法人	603	73,023,300	
	東海道リート投資法人	177	22,549,800	
	日本アコモデーションファンド投資法人	415	252,320,000	
	森ヒルズリート投資法人	1,416	199,089,600	
	産業ファンド投資法人	1,836	253,368,000	
	アドバンス・レジデンス投資法人	1,179	383,175,000	
	アクティビア・プロパティーズ投資法人	630	256,095,000	
	GLP投資法人	4,059	567,042,300	
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	592	188,256,000	
	日本プロロジスリート投資法人	2,093	586,877,200	
	星野リゾート・リート投資法人	222	134,310,000	
	Oneリート投資法人	209	55,573,100	
	イオンリート投資法人	1,472	211,673,600	
	ヒューリックリート投資法人	1,126	174,642,600	
	日本リート投資法人	389	136,150,000	
	積水ハウス・リート投資法人	3,614	306,105,800	
トーセイ・リート投資法人	249	33,490,500		
ヘルスケア&メディカル投資法人	294	42,100,800		

サムティ・レジデンシャル投資法人	326	36,675,000	
野村不動産マスターファンド投資法人	3,884	659,503,200	
いちごホテルリート投資法人	198	21,225,600	
ラサールロジポート投資法人	1,539	242,546,400	
スターアジア不動産投資法人	1,847	106,571,900	
マリモ地方創生リート投資法人	184	23,552,000	
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	499	233,033,000	
大江戸温泉リート投資法人	177	11,044,800	
投資法人みらい	1,649	72,885,800	
三菱地所物流リート投資法人	414	158,562,000	
C R E ロジスティクスファンド投資法人	519	85,271,700	
ザイマックス・リート投資法人	192	22,636,800	
タカラレーベン不動産投資法人	573	58,159,500	
アドバンス・ロジスティクス投資法人	530	68,211,000	
日本ビルファンド投資法人	1,403	871,263,000	
ジャパンリアルエステイト投資法人	1,234	709,550,000	
日本都市ファンド投資法人	5,759	567,261,500	
オリックス不動産投資法人	2,394	417,513,600	
日本プライムリアルティ投資法人	822	304,962,000	
N T T 都市開発リート投資法人	1,218	155,295,000	
東急リアル・エステート投資法人	808	145,763,200	
グローバル・ワン不動産投資法人	892	102,401,600	
ユナイテッド・アーバン投資法人	2,689	389,905,000	
森トラストリート投資法人	2,322	171,131,400	
インヴィンシブル投資法人	5,821	349,260,000	
フロンティア不動産投資法人	445	201,807,500	
平和不動産リート投資法人	901	121,995,400	
日本ロジスティクスファンド投資法人	769	221,856,500	
福岡リート投資法人	625	104,000,000	
K D X 不動産投資法人	3,458	586,131,000	
いちごオフィスリート投資法人	990	83,952,000	
大和証券オフィス投資法人	251	169,927,000	
阪急阪神リート投資法人	576	81,388,800	
スターツプロシード投資法人	208	42,702,400	
大和ハウスリート投資法人	1,812	478,005,600	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	4,024	279,265,600	
大和証券リビング投資法人	1,781	194,663,300	
ジャパンエクセレント投資法人	1,047	147,731,700	
投資証券 小計		12,637,122,100	
合計		12,637,122,100	



## デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

## 外国リート・インデックス・マザーファンド

## ( 1 ) 貸借対照表

( 単位：円 )

	( 2022年11月30日現在 )	( 2023年11月30日現在 )
資産の部		
流動資産		
預金	179,631,581	355,983,753
金銭信託	25,566,164	1,004,100
コール・ローン	157,745,488	60,293,660
投資証券	24,586,639,159	29,945,653,349
派生商品評価勘定	1,047	323
未収入金	1,170,969	7,390,605
未収配当金	39,192,137	48,688,849
流動資産合計	24,989,946,545	30,419,014,639
資産合計	24,989,946,545	30,419,014,639
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	170,425	91,160
未払金	78,556,684	-
未払解約金	31,589,177	84,125,274
その他未払費用	371	173
流動負債合計	110,316,657	84,216,607
負債合計	110,316,657	84,216,607
純資産の部		
元本等		
元本	8,860,732,746	10,265,225,929
剰余金		
剰余金又は欠損金 ( )	16,018,897,142	20,069,572,103
元本等合計	24,879,629,888	30,334,798,032
純資産合計	24,879,629,888	30,334,798,032
負債純資産合計	24,989,946,545	30,419,014,639

## ( 2 ) 注記表

## ( 重要な会計方針の注記 )

項 目	自 2022年12月1日 至 2023年11月30日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。 (1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。

	<p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券</p> <p>金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券</p> <p>直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>
3. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	<p>外貨建資産等の会計処理</p> <p>「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。</p>

（重要な会計上の見積りに関する注記）

会計上の見積りについて、翌計算期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクがある項目を識別していないため、注記を省略しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	（2022年11月30日現在）	（2023年11月30日現在）
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	8,860,732,746口	10,265,225,929口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 2.8079円 （1万口当たりの純資産額28,079円）	1口当たり純資産額 2.9551円 （1万口当たりの純資産額29,551円）

（金融商品に関する注記）

・金融商品の状況に関する事項

項目	自 2022年12月1日 至 2023年11月30日
1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。</p>
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券</p> <p>当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、投資証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引</p> <p>当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。</p> <p>当計算期間については、為替予約取引を行っております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p>

	<p>(2) 金融商品に係るリスク</p> <p>有価証券およびデリバティブ取引等</p> <p>当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。なお、投資信託協会の流動性リスク管理規制に抵触する場合には、流動性リスクを管理する会議で審議の上、流動性リスクの管理責任者が対処方針を決定します。その後、決定した対処方針やその実施等について、リスク管理会議に報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>

### ・金融商品の時価等に関する事項

項目	(2023年11月30日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（投資証券）</p> <p>「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引）</p> <p>デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。

(デリバティブ取引に関する注記)

(2022年11月30日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			うち 1年超		
市場取引以外 の取引	為替予約取引 買建				
	アメリカ・ドル	130,100,000	-	130,003,672	96,328
	オーストラリア・ド ル	14,300,000	-	14,243,620	56,380
	シンガポール・ドル	2,300,000	-	2,300,972	972
	イギリス・ポンド	1,800,000	-	1,782,358	17,642
	小計	148,500,000	-	148,330,622	169,378
合 計		148,500,000	-	148,330,622	169,378

(2023年11月30日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			うち 1年超		
市場取引以外 の取引	為替予約取引 買建				
	アメリカ・ドル	6,400,000	-	6,355,091	44,909
	小計	6,400,000	-	6,355,091	44,909
	売建				
	アメリカ・ドル	51,900,000	-	51,945,928	45,928
	小計	51,900,000	-	51,945,928	45,928
合 計		58,300,000	-	58,301,019	90,837

(注) 1. 時価の算定方法

為替予約取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

1) 計算期間末日に対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。

計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

- ・ 計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、発表されている対顧客先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの対顧客先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。
- ・ 計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い受渡日として、発表されている対顧客先物相場の仲値を用いております。

2)計算期間末日において対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については、計算期間末日の対顧客相場の仲値で評価しております。

3)上記の算定方法にて、適正な時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認められた価額で評価しております。

2.ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

自 2022年12月1日 至 2023年11月30日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

(その他の注記)

(2022年11月30日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	6,336,539,299円
同期中における追加設定元本額	3,494,346,976円
同期中における一部解約元本額	970,153,529円
2022年11月30日現在の元本の内訳	
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	12,940,527円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	17,073,331円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	12,567,990円
三井住友・DC外国リートインデックスファンド	7,380,775,925円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	6,434,883円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	58,606,602円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	44,014,413円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	153,929,966円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	87,821,388円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	69,286,976円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	89,559,984円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	845,457円
三井住友DS・外国リートインデックス年金ファンド	325,259,559円
日興FWS・Gリートインデックス(為替ヘッジあり)	78,592,105円
日興FWS・Gリートインデックス(為替ヘッジなし)	387,230,766円
三井住友DS・先進国リートインデックス・ファンド	31,002,495円
SMAM・世界リート・インデックスファンドVA<適格機関投資家限定>	36,000,406円
SMAM・年金WRリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	31,377,238円
SMDAM・リスクコントロール型バランスファンド202105(リスク3%) <適格機関投資家限定>	37,412,735円
合計	8,860,732,746円

(2023年11月30日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	8,860,732,746円
同期中における追加設定元本額	2,651,954,776円
同期中における一部解約元本額	1,247,461,593円

## 2023年11月30日現在の元本の内訳

アセットアロケーション・ファンド(安定型)	1,747,688円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	10,939,878円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	9,172,834円
イオン・バランス戦略ファンド	21,702,788円
三井住友・DC外国リートインデックスファンド	8,256,423,783円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2050	9,011,339円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	38,185,943円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	38,681,630円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	158,220,334円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	99,077,748円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	74,406,690円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	120,363,940円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2060	1,065,539円
三井住友DS・外国リートインデックス年金ファンド	358,364,115円
日興FWS・Gリートインデックス(為替ヘッジあり)	78,516,189円
日興FWS・Gリートインデックス(為替ヘッジなし)	752,195,424円
三井住友DS・先進国リートインデックス・ファンド	116,701,591円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2035	122,343円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2040	76,088円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2045	71,650円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2055	23,334円
三井住友DS・DCターゲットイヤーファンド2065	39,240円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル1(保守型)	37,093円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル2(安定型)	452,094円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル3(安定成長型)	2,315,174円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル4(成長型)	1,345,105円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル5(積極成長型)	598,077円
SMAM・世界リート・インデックスファンドVA<適格機関投資家限定>	33,904,762円
SMAM・年金WRリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	48,136,924円
SMDAM・リスクコントロール型バランスファンド202105(リスク3%) <適格機関投資家限定>	33,326,592円
合計	10,265,225,929円

## (3) 附属明細表

## 有価証券明細表

## (a) 株式

該当事項はありません。

## (b) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	アメリカ・ドル	ACADIA REALTY TRUST	14,653.00	219,208.88	
		AGREE REALTY CORP	15,181.00	886,114.97	
		ALEXANDER & BALDWIN INC	12,195.00	202,558.95	
		ALEXANDER'S INC	300.00	55,020.00	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	25,833.00	2,816,055.33	

ALPINE INCOME PROPERTY TRUST	2,165.00	35,029.70	
AMERICAN ASSETS TRUST INC	7,000.00	138,600.00	
AMERICAN HOMES 4 RENT- A	51,482.00	1,842,540.78	
AMERICOLD REALTY TRUST INC	41,510.00	1,169,751.80	
APARTMENT INCOME REIT CO	23,374.00	721,087.90	
APARTMENT INVT & MGMT CO -A	23,200.00	159,848.00	
APPLE HOSPITALITY REIT INC	37,103.00	610,344.35	
ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN	8,429.00	91,033.20	
ASHFORD HOSPITALITY TRUST	2,515.00	5,432.40	
AVALONBAY COMMUNITIES INC	23,438.00	4,003,913.54	
BOSTON PROPERTIES INC	23,671.00	1,349,247.00	
BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	8,400.00	18,228.00	
BRANDYWINE REALTY TRUST	34,607.00	156,077.57	
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	49,398.00	1,053,165.36	
BROADSTONE NET LEASE INC	31,774.00	504,253.38	
BRT APARTMENTS CORP	500.00	9,040.00	
CAMDEN PROPERTY TRUST	17,305.00	1,553,123.75	
CARETRUST REIT INC	16,295.00	372,829.60	
CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	3,648.00	85,034.88	
CENTERSPACE	2,600.00	139,100.00	
CHATHAM LODGING TRUST	5,557.00	54,792.02	
CITY OFFICE REIT INC	4,603.00	22,186.46	
CLIPPER REALTY INC	800.00	4,104.00	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	3,216.00	86,832.00	
COPT DEFENSE PROPERTIES	20,034.00	487,226.88	
COUSINS PROPERTIES INC	22,991.00	470,165.95	
CTO REALTY GROWTH INC	3,839.00	64,879.10	
CUBESMART	36,606.00	1,451,793.96	
DIAMONDRock HOSPITALITY CO	33,165.00	274,606.20	
DIGITAL CORE REIT MANAGEMENT	69,000.00	41,055.00	
DIGITAL REALTY TRUST INC	49,765.00	6,877,523.00	
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	23,884.00	53,500.16	
DOUGLAS EMMETT INC	26,346.00	324,055.80	
EAGLE HOSPITALITY TRUST	20,000.00	2,740.00	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERT I	15,924.00	185,992.32	
EASTGROUP PROPERTIES INC	7,419.00	1,276,587.33	
ELME COMMUNITIES	15,190.00	200,204.20	
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	21,276.00	191,484.00	
EPR PROPERTIES	12,612.00	560,225.04	
EQUINIX INC	15,309.00	12,374,417.79	
EQUITY COMMONWEALTH	17,598.00	328,554.66	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	30,117.00	2,110,900.53	
EQUITY RESIDENTIAL	57,073.00	3,229,190.34	
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	26,412.00	620,946.12	

ESSEX PROPERTY TRUST INC	10,670.00	2,264,494.10	
EXTRA SPACE STORAGE INC	34,895.00	4,519,949.35	
FARMLAND PARTNERS INC	7,194.00	90,356.64	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	12,031.00	1,134,763.92	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	21,613.00	998,952.86	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	13,780.00	314,873.00	
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	15,115.00	37,031.75	
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	42,352.00	1,943,109.76	
GETTY REALTY CORP	6,971.00	201,880.16	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	5,368.00	68,442.00	
GLADSTONE LAND CORP	4,464.00	64,772.64	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	12,642.00	126,040.74	
GLOBAL NET LEASE INC	30,518.00	268,863.58	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	64,877.00	981,589.01	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	89,400.00	1,532,316.00	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	16,359.00	306,240.48	
HOST HOTELS & RESORTS INC	117,928.00	2,056,664.32	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	17,289.00	102,177.99	
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	36,893.00	499,531.22	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	6,274.00	21,206.12	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	4,322.00	348,396.42	
INVENTRUST PROPERTIES CORP	11,866.00	284,546.68	
INVITATION HOMES INC	95,236.00	3,138,978.56	
IRON MOUNTAIN INC	47,715.00	3,019,405.20	
JBG SMITH PROPERTIES	14,792.00	205,608.80	
KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	130,900.00	35,343.00	
KILROY REALTY CORP	16,719.00	556,909.89	
KIMCO REALTY CORP	103,398.00	1,966,629.96	
KITE REALTY GROUP TRUST	34,000.00	705,160.00	
LTC PROPERTIES INC	7,251.00	235,149.93	
LXP INDUSTRIAL TRUST	43,773.00	379,511.91	
MACERICH CO/THE	32,750.00	372,040.00	
MANULIFE US REAL ESTATE INV	245,900.00	22,376.90	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	97,588.00	478,181.20	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	19,384.00	2,400,902.24	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	13,122.00	433,550.88	
NATL HEALTH INVESTORS INC	7,193.00	391,874.64	
NET LEASE OFFICE PROPERTY	2,253.00	37,737.75	
NETSTREIT CORP	8,448.00	129,592.32	
NEXPOINT DIVERSIFIED REAL ES	7,564.00	61,268.40	
NEXPOINT RESIDENTIAL	3,529.00	107,493.34	
NNN REIT INC	30,814.00	1,233,176.28	
OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	9,538.00	53,889.70	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	38,797.00	1,211,242.34	



ONE LIBERTY PROPERTIES INC	2,352.00	47,298.72	
ORION OFFICE REIT INC	8,094.00	42,736.32	
PARAMOUNT GROUP INC	23,577.00	112,462.29	
PARK HOTELS & RESORTS INC	35,722.00	523,327.30	
PEAKSTONE REALTY TRUST	7,728.00	126,816.48	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	20,329.00	258,788.17	
PHILLIPS EDISON & COMPANY IN	19,743.00	694,361.31	
PHYSICIANS REALTY TRUST	36,597.00	424,891.17	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	19,902.00	124,188.48	
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	4,774.00	103,022.92	
POSTAL REALTY TRUST INC- A	1,424.00	19,907.52	
PRIME US REIT	130,700.00	19,866.40	
PROLOGIS INC	150,979.00	17,066,666.16	
PUBLIC STORAGE	26,016.00	6,709,526.40	
REALTY INCOME CORP	116,604.00	6,258,136.68	
REGENCY CENTERS CORP	26,538.00	1,631,290.86	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	22,092.00	282,335.76	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	33,737.00	1,642,654.53	
RLJ LODGING TRUST	24,132.00	256,523.16	
RPT REALTY	11,788.00	134,972.60	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	9,829.00	970,613.75	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	37,565.00	540,184.70	
SAFEHOLD INC	5,574.00	110,253.72	
SAUL CENTERS INC	2,331.00	84,941.64	
SERVICE PROPERTIES TRUST	25,446.00	181,175.52	
SIMON PROPERTY GROUP INC	53,803.00	6,604,856.28	
SITE CENTERS CORP	32,493.00	422,084.07	
SL GREEN REALTY CORP	9,537.00	354,394.92	
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	22,155.00	907,468.80	
STAG INDUSTRIAL INC	29,361.00	1,052,004.63	
STAR HOLDINGS	2,111.00	25,944.19	
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	14,098.00	88,112.50	
SUN COMMUNITIES INC	20,036.00	2,564,608.00	
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	32,379.00	315,695.25	
TANGER INC	17,266.00	428,542.12	
TERRENO REALTY CORP	13,412.00	760,058.04	
UDR INC	48,632.00	1,618,959.28	
UMH PROPERTIES INC	11,316.00	160,460.88	
UNITI GROUP INC	46,029.00	255,921.24	
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	1,344.00	53,598.72	
URBAN EDGE PROPERTIES	20,402.00	337,041.04	
VENTAS INC	65,757.00	2,986,025.37	
VERIS RESIDENTIAL INC	10,798.00	153,331.60	
VICI PROPERTIES INC	166,963.00	4,945,444.06	

	VORNADO REALTY TRUST	27,860.00	661,953.60	
	WELLTOWER INC	90,088.00	7,945,761.60	
	WHITESTONE REIT	4,511.00	49,169.90	
	WP CAREY INC	35,014.00	2,177,520.66	
	XENIA HOTELS & RESORTS INC	17,827.00	216,419.78	
	アメリカ・ドル小計	4,205,562.00	158,285,143.27 (23,278,996,021)	
カナダ・ドル	ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	8,800.00	158,576.00	
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	9,662.00	60,290.88	
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	3,190.00	210,699.50	
	BSR REAL ESTATE INVESTMENT T	3,187.00	45,414.75	
	BTB REAL ESTATE INVESTMENT T	6,841.00	19,428.44	
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	14,509.00	664,802.38	
	CHOICE PROPERTIES REIT	23,858.00	307,291.04	
	CROMBIE REAL ESTATE INVESTME	10,639.00	134,583.35	
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	9,193.00	124,565.15	
	DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	23,474.00	293,190.26	
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	5,465.00	48,966.40	
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	14,775.00	204,486.00	
	GRANITE REAL ESTATE INVESTME	5,260.00	362,729.60	
	H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	21,001.00	186,908.90	
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	11,198.00	137,175.50	
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	8,107.00	138,629.70	
	MINTO APARTMENT REAL ESTATE	1,447.00	21,256.43	
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESI	1,557.00	20,692.53	
	NEXUS INDUSTRIAL REIT	4,345.00	32,239.90	
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	20,754.00	93,393.00	
PRIMARIS REIT	6,318.00	83,587.14		
PRO REAL ESTATE INVESTMENT T	15,604.00	71,934.44		
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	24,676.00	430,102.68		
SLATE GROCERY REIT-CL U	3,196.00	33,462.12		
SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	12,000.00	273,240.00		
TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	829.00	5,570.88		
	カナダ・ドル小計	269,885.00	4,163,216.97 (450,501,708)	
オーストラリア・ドル	ABACUS GROUP	50,980.00	53,274.10	
	ABACUS STORAGE KING	145,482.00	155,665.74	
	ARENA REIT	45,981.00	156,335.40	
	BWP TRUST	66,965.00	228,350.65	
	CENTURIA CAPITAL GROUP	104,758.00	151,899.10	
	CENTURIA INDUSTRIAL REIT	84,443.00	255,017.86	
	CENTURIA OFFICE REIT	68,559.00	86,041.54	
	CHARTER HALL GROUP	83,440.00	864,438.40	
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	97,225.00	324,731.50	

	CHARTER HALL RETAIL REIT	91,686.00	293,395.20	
	CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	72,491.00	190,651.33	
	CROMWELL PROPERTY GROUP	218,718.00	94,048.74	
	DEXUS INDUSTRIA REIT	30,237.00	79,825.68	
	DEXUS/AU	168,087.00	1,176,609.00	
	GDI PROPERTY GROUP	83,204.00	47,426.28	
	GOODMAN GROUP	280,151.00	6,533,121.32	
	GPT GROUP	305,971.00	1,248,361.68	
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	52,361.00	121,477.52	
	HEALTHCO REIT	51,410.00	72,745.15	
	HMC CAPITAL LTD	33,678.00	162,327.96	
	HOMEKO DAILY NEEDS REIT	332,002.00	373,502.25	
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS	25,921.00	69,209.07	
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	62,840.00	258,272.40	
	MIRVAC GROUP	634,643.00	1,250,246.71	
	NATIONAL STORAGE REIT	208,817.00	448,956.55	
	REGION RE LTD	191,819.00	395,147.14	
	RURAL FUNDS GROUP	52,739.00	100,731.49	
	SCENTRE GROUP	845,820.00	2,224,506.60	
	STOCKLAND	406,134.00	1,652,965.38	
	VICINITY CENTRES	664,812.00	1,206,633.78	
	WAYPOINT REIT	113,111.00	265,810.85	
	オーストラリア・ドル小計	5,674,485.00	20,541,726.37 (2,001,791,235)	
香港・ドル	CHAMPION REIT	277,000.00	714,660.00	
	FORTUNE REIT	259,000.00	1,243,200.00	
	LINK REIT	419,100.00	16,302,990.00	
	PROSPERITY REIT	178,000.00	243,860.00	
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST	202,000.00	406,020.00	
	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN	293,000.00	360,390.00	
	香港・ドル小計	1,628,100.00	19,271,120.00 (363,067,901)	
シンガポール・ドル	AIMS APAC REIT	113,300.00	145,024.00	
	CAPITALAND ASCENDAS REIT	582,700.00	1,654,868.00	
	CAPITALAND ASCOTT TRUST	428,155.00	396,043.37	
	CAPITALAND CHINA TRUST	205,700.00	168,674.00	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMERC	828,408.00	1,532,554.80	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	159,550.00	162,741.00	
	EC WORLD REIT	52,800.00	14,784.00	
	ESR-LOGOS REIT	1,097,413.00	329,223.90	
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	190,000.00	124,450.00	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	166,800.00	366,960.00	
	FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL	433,738.00	477,111.80	
	KEPPEL DC REIT	200,100.00	374,187.00	

	KEPPEL REIT	363,300.00	312,438.00	
	LENLEASE GLOBAL COMMERCIAL	262,000.00	155,890.00	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	324,500.00	739,860.00	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	558,250.00	904,365.00	
	MAPLETREE PAN ASIA COM TRUST	355,000.00	486,350.00	
	PARAGON REIT	215,200.00	180,768.00	
	PARKWAYLIFE REAL ESTATE	69,800.00	244,998.00	
	SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	66,700.00	46,356.50	
	STARHILL GLOBAL REIT	195,000.00	94,575.00	
	SUNTEC REIT	410,700.00	472,305.00	
	シンガポール・ドル小計	7,279,114.00	9,384,527.37 (1,035,864,131)	
ニュージー ランド・ド ル	ARGOSY PROPERTY LTD	153,482.00	170,365.02	
	GOODMAN PROPERTY TRUST	163,249.00	340,374.16	
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	264,918.00	219,881.94	
	PRECINCT PROPERTIES GROUP	217,149.00	247,549.86	
	ニュージーランド・ドル小計	798,798.00	978,170.98 (88,720,108)	
イギリス・ ポンド	ABRDN PROPERTY INCOME TRUST	53,280.00	25,414.56	
	AEW UK REIT PLC	9,000.00	8,820.00	
	ASSURA PLC	472,915.00	216,595.07	
	BALANCED COMM PROPERTY TRUST	154,750.00	105,849.00	
	BIG YELLOW GROUP PLC	26,200.00	288,200.00	
	BRITISH LAND CO PLC	150,571.00	531,365.05	
	CLS HOLDINGS PLC	41,598.00	40,142.07	
	CUSTODIAN PROPERTY INCOME RE	84,958.00	75,867.49	
	DERWENT LONDON PLC	17,263.00	369,773.46	
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	95,000.00	88,825.00	
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	41,616.00	161,386.84	
	HAMMERSON PLC	591,835.00	160,387.28	
	HELICAL PLC	17,000.00	36,465.00	
	HOME REIT PLC	96,051.00	36,499.38	
	IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	88,651.00	75,796.60	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	127,936.00	804,205.69	
	LIFE SCIENCE REIT PLC	104,502.00	67,926.30	
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	170,834.00	317,751.24	
	LXI REIT PLC	313,466.00	299,046.56	
	NEWRIVER REIT PLC	46,021.00	39,117.85	
	PICTON PROPERTY INCOME LTD	57,141.00	37,141.65	
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	212,067.00	212,067.00	
	PRS REIT PLC/THE	89,207.00	71,097.97	
REGIONAL REIT LTD	159,212.00	48,878.08		
SAFESTORE HOLDINGS PLC	31,848.00	249,210.60		
SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	70,698.00	32,026.19		

	SEGR0 PLC	200,140.00	1,641,948.56	
	SHAFTESBURY CAPITAL PLC	304,853.00	365,213.89	
	SUPERMARKET INCOME REIT PLC	187,422.00	154,623.15	
	TARGET HEALTHCARE REIT PLC	113,949.00	95,717.16	
	TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	34,770.00	22,252.80	
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	322,665.00	497,226.76	
	UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	117,847.00	68,822.64	
	UNITE GROUP PLC/THE	62,834.00	617,344.05	
	URBAN LOGISTICS REIT PLC	76,400.00	90,304.80	
	WAREHOUSE REIT PLC	72,100.00	61,501.30	
	WORKSPACE GROUP PLC	20,210.00	109,336.10	
	イギリス・bond小計	4,836,810.00	8,124,147.14 (1,517,915,652)	
イスラエル・シュケル	MENIVIM- THE NEW REIT LTD	110,000.00	180,840.00	
	REIT 1 LTD	29,102.00	479,600.96	
	SELLA CAPITAL REAL ESTATE LT	36,242.00	313,928.20	
	イスラエル・シュケル小計	175,344.00	974,369.16 (38,890,386)	
韓国・ウォン	D&D PLATFORM REIT CO LTD	6,350.00	19,653,250.00	
	ESR KENDALL SQUARE REIT CO L	24,000.00	83,760,000.00	
	JR REIT XXVII	36,632.00	153,304,920.00	
	KORAMCO LIFE INFRA REIT	6,226.00	32,686,500.00	
	LOTTE REIT CO LTD	20,121.00	62,475,705.00	
	NH ALL-ONE REIT CO LTD	12,561.00	43,900,695.00	
	SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	8,762.00	56,953,000.00	
	SK REITS CO LTD	12,831.00	51,452,310.00	
	韓国・ウォン小計	127,483.00	504,186,380.00 (57,527,666)	
ユーロ	AEDIFICA	7,278.00	425,035.20	
	ALTAREA	723.00	50,682.30	
	CARE PROPERTY INVEST	5,582.00	71,561.24	
	CARMILA	10,208.00	147,607.68	
	COFINIMMO	5,913.00	385,823.25	
	COVIVIO	7,454.00	330,659.44	
	CROMWELL REIT EUR	48,320.00	63,782.40	
	EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	6,975.00	148,986.00	
	GECINA SA	8,447.00	854,836.40	
	HAMBORNER REIT AG	12,058.00	79,221.06	
	ICADE	4,873.00	164,512.48	
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	7,889.00	17,237.46	
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	44,900.00	271,420.50	
	INTERVEST OFFICES & WAREHOUS	4,899.00	100,674.45	
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	62,588.00	60,710.36	
	KLEPIERRE	32,475.00	750,172.50	
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	6,940.00	42,889.20	

	MERCIALYS	15,342.00	133,091.85	
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	52,906.00	489,909.56	
	MONTEA NV	2,735.00	211,962.50	
	NSI NV	2,966.00	51,311.80	
	RETAIL ESTATES	2,065.00	131,540.50	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	16,472.00	943,186.72	
	VASTNED RETAIL NV	2,919.00	56,862.12	
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	26,960.00	688,019.20	
	WERELDHAVE NV	6,708.00	103,303.20	
	XIOR STUDENT HOUSING NV	3,590.00	112,367.00	
	ユーロ小計	410,185.00	6,887,366.37 (1,112,378,541)	
投資証券合計			29,945,653,349 (29,945,653,349)	
合 計			29,945,653,349 (29,945,653,349)	

(注) 金額欄の( )内は、外貨建有価証券にかかるものの内書きであり、また邦貨換算金額で表示しております。

通貨	銘柄数	組入 投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカ・ドル	投資証券 142銘柄	76.7%	77.7%
カナダ・ドル	投資証券 26銘柄	1.5%	1.5%
オーストラリア・ドル	投資証券 31銘柄	6.6%	6.7%
香港・ドル	投資証券 6銘柄	1.2%	1.2%
シンガポール・ドル	投資証券 22銘柄	3.4%	3.5%
ニュージーランド・ドル	投資証券 4銘柄	0.3%	0.3%
イギリス・ポンド	投資証券 37銘柄	5.0%	5.1%
イスラエル・シケル	投資証券 3銘柄	0.1%	0.1%
韓国・ウォン	投資証券 8銘柄	0.2%	0.2%
ユーロ	投資証券 27銘柄	3.7%	3.7%

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

## ゴールド・インデックス・マザーファンド

### (1) 貸借対照表

(単位：円)

	(2022年11月30日現在)	(2023年11月30日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	44,944,694	75,643,585
金銭信託	4,242,207	1,122,545
コール・ローン	26,174,794	67,405,965
投資信託受益証券	3,754,431,327	7,656,872,025
派生商品評価勘定	1,728	-
流動資産合計	3,829,794,750	7,801,044,120
資産合計	3,829,794,750	7,801,044,120

負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	87
未払金	53,523,970	46,680,018
未払解約金	1,069,582	2,082,964
その他未払費用	122	126
流動負債合計	54,593,674	48,763,195
負債合計	54,593,674	48,763,195
純資産の部		
元本等		
元本	3,178,413,029	5,301,265,841
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	596,788,047	2,451,015,084
元本等合計	3,775,201,076	7,752,280,925
純資産合計	3,775,201,076	7,752,280,925
負債純資産合計	3,829,794,750	7,801,044,120

## (2) 注記表

## (重要な会計方針の注記)

項目	自 2022年12月1日 至 2023年11月30日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>
3. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	<p>外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。</p>

## (重要な会計上の見積りに関する注記)

会計上の見積りについて、翌計算期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクがある項目を識別していないため、注記を省略しております。

## (貸借対照表に関する注記)

項目	(2022年11月30日現在)	(2023年11月30日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	3,178,413,029口	5,301,265,841口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.1878円 (1万口当たりの純資産額11,878円)	1口当たり純資産額 1.4623円 (1万口当たりの純資産額14,623円)

## (金融商品に関する注記)

## . 金融商品の状況に関する事項

項目	自 2022年12月1日 至 2023年11月30日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、投資信託受益証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。 当計算期間については、為替予約取引を行っております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>



<p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p>	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。なお、投資信託協会の流動性リスク管理規制に抵触する場合には、流動性リスクを管理する会議で審議の上、流動性リスクの管理責任者が対処方針を決定します。その後、決定した対処方針やその実施等について、リスク管理会議に報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>
--------------------------	--

・金融商品の時価等に関する事項

項目	(2023年11月30日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。

(デリバティブ取引に関する注記)

(2022年11月30日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			う ち 1 年 超		
市場取引以外 の取引	為替予約取引 買建				
	アメリカ・ドル	39,987,446	-	39,989,174	1,728
	小計	39,987,446	-	39,989,174	1,728
合 計		39,987,446	-	39,989,174	1,728

(2023年11月30日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			う ち 1 年 超		
市場取引以外 の取引	為替予約取引 買建				
	アメリカ・ドル	18,380,862	-	18,380,775	87
	小計	18,380,862	-	18,380,775	87
合 計		18,380,862	-	18,380,775	87

(注) 1. 時価の算定方法

為替予約取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

1) 計算期間末日に対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。

計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

- ・ 計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、発表されている対顧客先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの対顧客先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。
- ・ 計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い受渡日として、発表されている対顧客先物相場の仲値を用いております。

2) 計算期間末日において対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については、計算期間末日の対顧客相場の仲値で評価しております。

3) 上記の算定方法にて、適正な時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認められた価額で評価しております。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

自 2022年12月1日 至 2023年11月30日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

## （その他の注記）

（2022年11月30日現在）	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	864,264,346円
同期中における追加設定元本額	2,632,159,819円
同期中における一部解約元本額	318,011,136円
2022年11月30日現在の元本の内訳	
日興FWS・ゴールド（為替ヘッジあり）	316,496,322円
日興FWS・ゴールド（為替ヘッジなし）	2,580,676,358円
三井住友DS・ゴールドインデックス・ファンド（為替ヘッジあり）	281,240,349円
合計	3,178,413,029円

（2023年11月30日現在）	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	3,178,413,029円
同期中における追加設定元本額	2,708,990,405円
同期中における一部解約元本額	586,137,593円
2023年11月30日現在の元本の内訳	
日興FWS・ゴールド（為替ヘッジあり）	270,614,271円
日興FWS・ゴールド（為替ヘッジなし）	4,341,842,539円
三井住友DS・ゴールドインデックス・ファンド（為替ヘッジあり）	611,848,174円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル1（保守型）	352,123円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル2（安定型）	8,497,454円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル3（安定成長型）	38,302,374円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル4（成長型）	21,017,511円
三井住友DS・FW専用ポートフォリオ・レベル5（積極成長型）	8,791,395円
合計	5,301,265,841円

## （3）附属明細表

## 有価証券明細表

## (a) 株式

該当事項はありません。

## (b) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考	
投資信託受益証券	アメリカ・ドル	ISHARES GOLD TRUST	429,740.00	16,635,235.40		
		SPDR GOLD MINISHARES TRUST	873,460.00	35,427,537.60		
	アメリカ・ドル小計		1,303,200.00	52,062,773.00	(7,656,872,025)	
投資信託受益証券合計				7,656,872,025	(7,656,872,025)	
合計				7,656,872,025	(7,656,872,025)	

（注）金額欄の（ ）内は、外貨建有価証券にかかるものの内書きであり、また邦貨換算金額で表示しております。

通貨	銘柄数	組入 投資信託受益証券 時価比率	合計金額に 対する比率	
アメリカ・ドル	投資信託受益証券	2銘柄	98.8%	100.0%

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

## 2【ファンドの現況】

## 【純資産額計算書】

## 三井住友DS・TOPIXインデックス・ファンド

2023年12月29日現在

資産総額	357,733,766円
負債総額	86,785円
純資産総額( - )	357,646,981円
発行済口数	271,268,181口
1口当たり純資産額( / ) (1万口当たり純資産額)	1.3184円 (13,184円)

## 三井住友DS・日経225インデックス・ファンド

2023年12月29日現在

資産総額	508,818,953円
負債総額	3,995,360円
純資産総額( - )	504,823,593円
発行済口数	390,608,800口
1口当たり純資産額( / ) (1万口当たり純資産額)	1.2924円 (12,924円)

## 三井住友DS・先進国株式インデックス・ファンド

2023年12月29日現在

資産総額	942,226,792円
負債総額	322,369円
純資産総額( - )	941,904,423円
発行済口数	686,597,410口
1口当たり純資産額( / ) (1万口当たり純資産額)	1.3718円 (13,718円)

## 三井住友DS・新興国株式インデックス・ファンド

2023年12月29日現在

資産総額	134,721,294円
負債総額	49,624円
純資産総額( - )	134,671,670円
発行済口数	121,378,557口
1口当たり純資産額( / ) (1万口当たり純資産額)	1.1095円 (11,095円)

## 三井住友DS・先進国債インデックス・ファンド

2023年12月29日現在

資産総額	637,497,187円
負債総額	139,687円
純資産総額( - )	637,357,500円
発行済口数	588,176,443口
1口当たり純資産額( / ) (1万口当たり純資産額)	1.0836円 (10,836円)

## 三井住友DS・新興国債インデックス・ファンド

2023年12月29日現在

資産総額	55,307,235円
負債総額	15,093円
純資産総額( - )	55,292,142円
発行済口数	54,673,239口
1口当たり純資産額( / ) (1万口当たり純資産額)	1.0113円 (10,113円)

## 三井住友DS・国内リートインデックス・ファンド

2023年12月29日現在

資産総額	150,779,214円
負債総額	44,062円
純資産総額( - )	150,735,152円
発行済口数	163,894,032口
1口当たり純資産額( / ) (1万口当たり純資産額)	0.9197円 (9,197円)

## 三井住友DS・先進国リートインデックス・ファンド

2023年12月29日現在

資産総額	395,656,241円
負債総額	137,212円
純資産総額( - )	395,519,029円
発行済口数	331,177,840口
1口当たり純資産額( / ) (1万口当たり純資産額)	1.1943円 (11,943円)

## 三井住友DS・ゴールドインデックス・ファンド(為替ヘッジあり)

2023年12月29日現在

資産総額	956,310,807円
負債総額	397,367円
純資産総額( - )	955,913,440円
発行済口数	943,567,847口
1口当たり純資産額( / ) (1万口当たり純資産額)	1.0131円 (10,131円)

#### 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

ファンドの受益権は、社振法の規定の適用を受け、ファンドの受益権を取り扱う振替機関が社振法の規定により主務大臣の指定を取り消された場合または当該指定が効力を失った場合であって、当該振替機関の振替業を承継する者が存在しない場合その他やむを得ない事情等がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券は発行されません。

##### イ 名義書換

該当事項はありません。

##### ロ 受益者名簿

作成しません。

##### ハ 受益者に対する特典

ありません。

##### ニ 受益権の譲渡および譲渡制限等

###### (イ) 受益権の譲渡

- a. 受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等に振替の申請をするものとします。
- b. 上記aの申請のある場合には、上記aの振替機関等は、当該譲渡にかかる譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、上記aの振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社振法の規定に従い、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行われるよう通知するものとします。
- c. 上記aの振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託会社が必要と認めるときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

###### (ロ) 受益権の譲渡制限および譲渡の対抗要件

譲渡制限はありません。ただし、受益権の譲渡は、振替口座簿への記載または記録によらなければ、委託会社および受託会社に対抗することができません。

##### ホ 受益権の再分割

委託会社は、受託会社と協議の上、社振法に定めるところに従い、一定日現在の受益権を均等に再分割できるものとします。

##### ヘ 償還金

償還金は、原則として、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者に支払います。

##### ト 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

振替機関等の振替口座簿の質権口に記載または記録されている受益権にかかる収益分配金の支払い、一部解約の実行の請求の受付け、一部解約金および償還金の支払い等については、約款の規定によるほか、民法その他の法令等に従って取り扱われます。

## 第三部【委託会社等の情報】

### 第1【委託会社等の概況】

#### 1【委託会社等の概況】

##### イ 資本金の額および株式数

	2023年12月29日現在
資本金の額	20億円
会社が発行する株式の総数	60,000,000株
発行済株式総数	33,870,060株

##### ロ 最近5年間における資本金の額の増減 該当ありません。

#### ハ 会社の機構

委託会社の取締役は8名以内とし、株主総会で選任されます。取締役の選任決議は、議決権を行使することができる株主の議決権の3分の1以上を有する株主が出席し、その議決権の過半数をもって行い、累積投票によらないものとします。

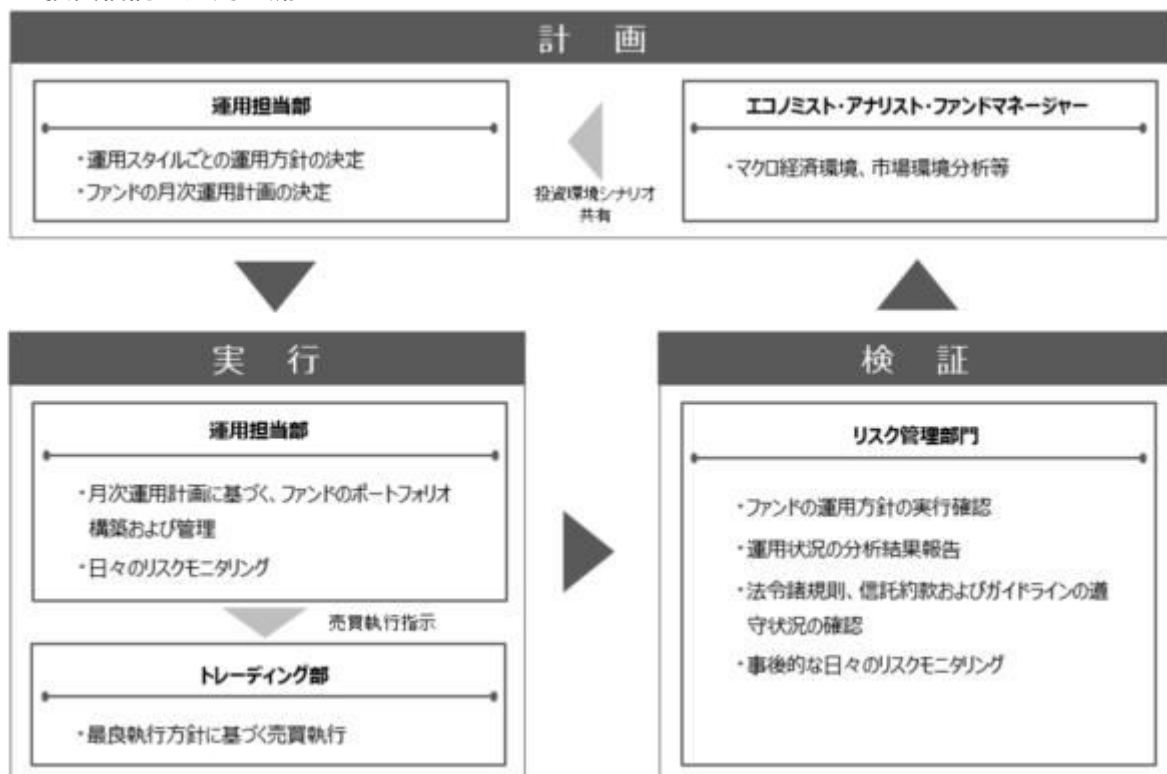
取締役の任期は、選任後1年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結の時までとし、補欠または増員によって選任された取締役の任期は、他の現任取締役の任期の満了する時までとします。

委託会社の業務上重要な事項は、取締役会の決議により決定します。

取締役会は、取締役会の決議によって、代表取締役若干名を選定します。

また、取締役会の決議によって、取締役社長を1名選定し、必要に応じて取締役会長1名を選定することができます。

#### ニ 投資信託の運用の流れ



#### 2【事業の内容及び営業の概況】

「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社である委託会社は、証券投資信託



の設定を行うとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者として投資運用業および投資助言業務を行っています。また、「金融商品取引法」に定める第二種金融商品取引業にかかる業務を行っています。

2023年12月29日現在、委託会社が運用を行っている投資信託（親投資信託は除きます）は、以下の通りです。

	本 数（本）	純資産総額（百万円）
追加型株式投資信託	691	11,388,930
単位型株式投資信託	98	672,908
追加型公社債投資信託	1	25,097
単位型公社債投資信託	159	257,300
合 計	949	12,344,237

### 3【委託会社等の経理状況】

1 当社の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号。以下「財務諸表等規則」という。）並びに同規則第2条の規定により、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）に基づいて作成しております。

また、当社の中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）並びに同規則第38条及び第57条の規定により、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）に基づいて作成しております。

なお、当中間会計期間（2023年4月1日から2023年9月30日まで）は、改正府令附則第3条第1項ただし書きにより、改正後の中間財務諸表等規則に基づいて作成しております。

2 当社は、第38期（2022年4月1日から2023年3月31日まで）の財務諸表については、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、有限責任 あずさ監査法人の監査を受けており、第39期中間会計期間（2023年4月1日から2023年9月30日まで）の中間財務諸表については、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、有限責任 あずさ監査法人の中間監査を受けております。

#### （1）【貸借対照表】

	（単位：千円）	
	前事業年度 （2022年3月31日）	当事業年度 （2023年3月31日）
資産の部		
流動資産		
現金及び預金	49,008,279	37,742,400
金銭の信託	-	12,645,575
顧客分別金信託	300,041	300,046
前払費用	475,266	546,900
未収入金	103,809	437,880
未収委託者報酬	12,125,117	11,563,662
未収運用受託報酬	2,437,063	2,138,030
未収投資助言報酬	388,639	344,586
未収収益	36,700	35,477
その他の流動資産	18,458	8,423

流動資産合計		64,893,375	65,762,982
固定資産			
有形固定資産	1		
建物		1,433,442	1,361,305
器具備品		653,985	559,057
土地		710	710
リース資産		7,357	4,114
建設仮勘定		5,500	81,240
有形固定資産合計		2,100,996	2,006,427
無形固定資産			
ソフトウェア		2,766,476	2,414,295
ソフトウェア仮勘定		100,616	508,956
のれん		3,349,950	3,045,409
顧客関連資産		13,558,615	11,445,340
電話加入権		12,716	12,706
商標権		42	36
無形固定資産合計		19,788,417	17,426,744
投資その他の資産			
投資有価証券		14,212,354	9,222,276
関係会社株式		11,246,398	11,850,598
長期差入保証金		1,414,646	1,388,987
長期前払費用		77,936	80,207
会員権		90,479	90,479
貸倒引当金		20,750	20,750
投資その他の資産合計		27,021,065	22,611,799
固定資産合計		48,910,479	42,044,971
資産合計		113,803,855	107,807,953

(単位：千円)

	前事業年度 (2022年3月31日)	当事業年度 (2023年3月31日)
負債の部		
流動負債		
リース債務	3,567	2,564
顧客からの預り金	6,045	11,094
その他の預り金	196,515	128,069
未払金		
未払収益分配金	1,969	2,013
未払償還金	152	1,312
未払手数料	5,545,582	5,194,011
その他未払金	48,893	259,542
未払費用	7,379,404	6,370,986
未払消費税等	1,133,332	406,770
未払法人税等	2,455,291	333,009
賞与引当金	2,100,323	1,801,492
資産除去債務	7,192	13,940
その他の流動負債	40,396	73,657
流動負債合計	18,918,667	14,598,465
固定負債		
リース債務	4,525	1,960
繰延税金負債	1,279,409	550,493
退職給付引当金	5,084,506	5,027,832
その他の固定負債	4,620	-
固定負債合計	6,373,062	5,580,287
負債合計	25,291,730	20,178,752

## 純資産の部

株主資本		
資本金	2,000,000	2,000,000
資本剰余金		
資本準備金	8,628,984	8,628,984
その他資本剰余金	73,466,962	73,466,962
資本剰余金合計	82,095,946	82,095,946
利益剰余金		
利益準備金	284,245	284,245
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金	3,834,794	3,391,568
利益剰余金合計	4,119,040	3,675,814
株主資本計	88,214,986	87,771,760
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	297,138	142,558
評価・換算差額等合計	297,138	142,558
純資産合計	88,512,124	87,629,201
負債・純資産合計	113,803,855	107,807,953

## (2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	前事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	66,139,024	61,471,271
運用受託報酬	9,652,634	8,978,419
投資助言報酬	1,256,334	1,273,386
その他営業収益		
サービス支 hands 手数料	199,046	208,222
その他	32,936	22,995
営業収益計	77,279,976	71,954,296
営業費用		
支払手数料	30,522,133	28,036,456
広告宣伝費	330,161	294,588
調査費		
調査費	3,196,921	3,749,357
委託調査費	12,192,048	11,455,987
営業雑経費		
通信費	67,600	61,068
印刷費	494,834	452,951
協会費	34,433	38,701
諸会費	30,488	33,447
情報機器関連費	4,767,504	5,067,617
販売促進費	31,930	29,621
その他	181,301	197,696
営業費用合計	51,849,358	49,417,495
一般管理費		
給料		
役員報酬	263,893	219,872
給料・手当	8,664,828	7,807,797
賞与	991,916	1,042,472
賞与引当金繰入額	2,100,323	1,798,492

交際費	12,301	27,713
寄付金	29,273	25,518
事務委託費	1,422,189	1,727,189
旅費交通費	16,863	99,733
租税公課	476,729	352,030
不動産賃借料	1,289,256	1,268,303
退職給付費用	632,559	624,551
固定資産減価償却費	3,133,951	3,247,869
のれん償却費	304,540	304,540
諸経費	256,994	200,758
一般管理費合計	19,595,622	18,746,845
営業利益	5,834,995	3,789,956

(単位：千円)

	前事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
営業外収益		
受取配当金	7,666	1,755
受取利息	1,836	1,373
時効成立分配金・償還金	43,406	521
原稿・講演料	2,587	2,281
投資有価証券償還益	383,608	119,033
投資有価証券売却益	911,268	25,848
為替差益	4,673	5,816
雑収入	81,640	91,814
営業外収益合計	1,436,686	248,443
営業外費用		
金銭の信託運用損	-	454,339
投資有価証券償還損	146,219	83,598
投資有価証券売却損	81,384	152,691
雑損失	2,866	-
営業外費用合計	230,470	690,629
経常利益	7,041,212	3,347,770
特別損失		
固定資産除却損	1 83,651	13,203
システム統合関連費用	2 375,636	-
早期退職費用	3 260,075	126,832
支払補償費	4 -	30,075
その他特別損失	67,000	-
特別損失合計	786,362	170,111
税引前当期純利益	6,254,849	3,177,659
法人税、住民税及び事業税	3,101,482	1,622,064
法人税等調整額	965,673	541,433
法人税等合計	2,135,809	1,080,631
当期純利益	4,119,040	2,097,028

## (3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本							
	資本金	資本剰余金			利益剰余金			
		資本準備金	その他資本 剰余金	資本剰余金 合計	利益準備金	その他利益剰余金		
						配当準備 積立金	別途積立金	繰越利益 剰余金
当期首残高	2,000,000	8,628,984	81,927,000	90,555,984	284,245	60,000	1,476,959	10,281,242
当期変動額								
剰余金の配当								
欠損填補			8,460,037	8,460,037				8,460,037
当期純利益								4,119,040
任意積立金の 取崩						60,000	1,476,959	1,536,959
株主資本以外の 項目の当期変動 額（純額）								
当期変動額合計	-	-	8,460,037	8,460,037	-	60,000	1,476,959	14,116,037
当期末残高	2,000,000	8,628,984	73,466,962	82,095,946	284,245	-	-	3,834,794

	株主資本		評価・換算差額等		純資産合計
	利益剰余金	株主資本合計	その他有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
	利益剰余金 合計				
当期首残高	8,460,037	84,095,946	949,365	949,365	85,045,311
当期変動額					
剰余金の配当					
欠損填補	8,460,037	-			-
当期純利益	4,119,040	4,119,040			4,119,040
任意積立金の取崩	-	-			-
株主資本以外の 項目の当期変動 額（純額）			652,227	652,227	652,227
当期変動額合計	12,579,078	4,119,040	652,227	652,227	3,466,812
当期末残高	4,119,040	88,214,986	297,138	297,138	88,512,124

当事業年度（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本					
	資本金	資本剰余金			利益剰余金	
		資本準備金	その他資本剰余金	資本剰余金 合計	利益準備金	その他利益剰余金
						繰越利益剰余金
当期首残高	2,000,000	8,628,984	73,466,962	82,095,946	284,245	3,834,794
当期変動額						
剰余金の配当						2,540,254
当期純利益						2,097,028
株主資本以外の 項目の当期変動 額（純額）						
当期変動額合計	-	-	-	-	-	443,225
当期末残高	2,000,000	8,628,984	73,466,962	82,095,946	284,245	3,391,568

	株主資本		評価・換算差額等		純資産合計
	利益剰余金	株主資本合計	その他有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
	利益剰余金 合計				
当期首残高	4,119,040	88,214,986	297,138	297,138	88,512,124
当期変動額					
剰余金の配当	2,540,254	2,540,254			2,540,254
当期純利益	2,097,028	2,097,028			2,097,028
株主資本以外の 項目の当期変動 額（純額）			439,697	439,697	439,697
当期変動額合計	443,225	443,225	439,697	439,697	882,923
当期末残高	3,675,814	87,771,760	142,558	142,558	87,629,201

## [注記事項]

## (重要な会計方針)

## 1. 重要な資産の評価基準及び評価方法

## (1) 有価証券

子会社株式  
移動平均法による原価法

## その他有価証券

市場価格のない株式等以外

決算日の市場価格等に基づく時価法

（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定）

市場価格のない株式等

移動平均法による原価法

## (2) 金銭の信託

運用目的の金銭の信託：時価法

## 2. 固定資産の減価償却の方法

## (1) 有形固定資産（リース資産を除く）

定率法によっております。但し、建物(建物附属設備を除く)並びに2016年4月1日以降に取得した建物附属設備については、定額法によっております。

なお、主な耐用年数は次のとおりであります。

建物 8～50年

器具備品 4～15年

## (2) 無形固定資産（リース資産を除く）

定額法によっております。

なお、主な償却年数は次のとおりであります。

のれん 14年

顧客関連資産 6～19年

ソフトウェア（自社利用分） 5年

## (3) リース資産

所有権移転外ファイナンス・リース取引に係るリース資産

リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法を採用しております。

## 3. 引当金の計上基準

## (1) 貸倒引当金

債権の貸倒れによる損失に備えるため一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権等の特定の債権については個別に回収可能性を検討し、回収不能見込額を計上しております。

## (2) 賞与引当金

従業員賞与の支給に充てるため、将来の支給見込額のうち、当事業年度の負担額を計上しております。

## (3)退職給付引当金

従業員の退職金支給に備えるため、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき、当事業年度において発生していると認められる額を計上しております。

## 退職給付見込額の期間帰属方法

退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。

## 数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法

過去勤務費用については、その発生時において一時に費用処理しております。

数理計算上の差異については、その発生時において一時に費用処理しております。

## 4. 収益及び費用の計上基準

当社の顧客との契約から生じる収益に関する主要な事業における主な履行義務の内容及び収益を認識する通常の時点は以下のとおりであります。

## (1)委託者報酬

委託者報酬は、投資信託の信託約款に基づき日々の純資産額に対する一定割合として認識され、確定した報酬を受け取ります。当該報酬は投資信託の運用期間にわたり収益として認識しております。

## (2)運用受託報酬

運用受託報酬は、対象顧客との投資一任契約に基づき、主に契約期間内の月末純資産平均価額に対する一定割合として認識され、確定した報酬を受け取ります。当該報酬は対象口座の運用期間にわたり収益として認識しております。

## (3)投資助言報酬

投資助言報酬は、対象顧客との投資助言契約に基づき、主に契約期間内の月末純資産平均価額に対する一定割合として認識され、確定した報酬を受け取ります。当該報酬は対象口座の助言期間にわたり収益として認識しております。

## (会計方針の変更)

「時価の算定に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第31号2021年6月17日。以下「時価算定会計基準適用指針」という。）等を当事業年度の期首から適用し、時価算定会計基準適用指針第27-2項に定める経過的な取扱いに従って、時価算定基準等が定める新たな会計方針を、将来にわたって適用しております。これによる当事業年度の財務諸表に与える影響はありません。なお、時価算定会計基準適用指針27-3項に定める経過的な取扱いに従って、前事業年度に係る「金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項」注記については記載していません。

## (貸借対照表関係)

## 1 有形固定資産の減価償却累計額

	前事業年度 (2022年3月31日)	当事業年度 (2023年3月31日)
建物	210,548千円	301,463千円
器具備品	1,309,352千円	1,499,284千円
リース資産	6,073千円	7,493千円

## 2 当座借越契約

当社は、運転資金の効率的な調達を行うため取引銀行1行と当座借越契約を締結しております。当座借越契約に係る借入金未実行残高等は次のとおりであります。

	前事業年度 (2022年3月31日)	当事業年度 (2023年3月31日)
当座借越極度額の総額	10,000,000千円	10,000,000千円
借入実行残高	- 千円	- 千円
差引額	10,000,000千円	10,000,000千円

## 3 保証債務

当社は、子会社であるSumitomo Mitsui DS Asset Management (USA) Inc.における賃貸借契約に係る賃借料に対し、2023年6月までの賃借料総額の支払保証を行っております。

	前事業年度 (2022年3月31日)	当事業年度 (2023年3月31日)
Sumitomo Mitsui DS Asset Management (USA) Inc.	57,356千円	12,514千円

## (損益計算書関係)

## 1 固定資産除却損

	前事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
建物	- 千円	2,482千円
器具備品	0千円	4,273千円
リース資産	- 千円	532千円
ソフトウェア	83,651千円	5,915千円

## 2 システム統合関連費用

社内システム統合に伴うものであり、主にデータの移行費用などであります。

## 3 早期退職費用

早期希望退職の募集等の実施に関連して発生する費用であります。

## 4 支払補償費

受益者や販売会社に生じた損失の補償に伴い発生する費用であります。

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

## 1. 発行済株式数に関する事項

	当期首株式数	当期増加株式数	当期減少株式数	当期末株式数
普通株式	33,870,060株	-	-	33,870,060株

## 2. 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生が翌事業年度になるもの

決議	株式の種類	配当金の総額 (千円)	一株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
2022年6月28日 定時株主総会	普通株式	2,540,254	75.00	2022年 3月31日	2022年 6月29日

当事業年度(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

## 1. 発行済株式数に関する事項

	当期首株式数	当期増加株式数	当期減少株式数	当期末株式数
普通株式	33,870,060株	-	-	33,870,060株

## 2. 剰余金の配当に関する事項

配当金支払額等

決議	株式の種類	配当金の総額 (千円)	一株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
2022年6月28日 定時株主総会	普通株式	2,540,254	75.00	2022年 3月31日	2022年 6月29日

基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生が翌事業年度になるもの

決議	株式の種類	配当金の総額 (千円)	一株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
2023年6月28日 定時株主総会	普通株式	1,591,892	47.00	2023年 3月31日	2023年 6月29日

(リース取引関係)

オペレーティング・リース取引

(借主側)

オペレーティング・リース取引のうち解約不能のものに係る未経過リース料

(単位：千円)

	前事業年度 (2022年3月31日)	当事業年度 (2023年3月31日)
1年以内	1,166,952	1,161,545
1年超	2,323,090	1,161,545
合計	3,490,042	2,323,090



## (金融商品関係)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

## (1) 金融商品に対する取組方針

当社は、投資運用業及び投資助言業などの金融サービス事業を行っており、当社が設定する投資信託の事業推進等を目的として、直接または特定金外信託を通じて当該投資信託を保有しております。特定金外信託を通じ行っているデリバティブ取引については、保有する投資信託にかかる将来の為替及び価格の変動によるリスクの軽減を目的としているため、投資信託保有残高の範囲内で行うこととし、投機目的のためのデリバティブ取引は行わない方針であります。

なお、資金運用については、短期的で安全性の高い金融資産に限定し、財務体質の健全性、安全性、流動性の確保を第一とし、顧客利益に反しない運用を行っています。

また、資金調達は行っていません。

## (2) 金融商品の内容及びそのリスク

営業債権である未収運用受託報酬及び未収投資助言報酬は、顧客の信用リスクに晒されています。未収委託者報酬は、信託財産中から支弁されるものであり、信託財産については受託者である信託銀行において分別管理されているため、リスクは僅少となっています。

金銭の信託及び投資有価証券については、主に事業推進目的のために保有する当社が設定する投資信託等であり、市場価格の変動リスク及び発行体の信用リスクに晒されています。関係会社株式については、主に全額出資の子会社の株式であり、発行体の信用リスクに晒されています。

営業債務である未払手数料は、すべて1年以内の支払期日であります。

## (3) 金融商品に係るリスク管理体制

## 信用リスクの管理

当社は、資産の自己査定及び償却・引当規程に従い、営業債権について取引先毎の期日管理及び残高管理を行うとともに、その状況について取締役会に報告しています。

金銭の信託、投資有価証券及び子会社株式は発行体の信用リスクについて、資産の自己査定及び償却・引当規程に従い、定期的に管理を行い、その状況について取締役会に報告しています。

## 市場リスクの管理

金銭の信託及び投資有価証券については、自己勘定資産の運用・管理に関する規程に従い、各所管部においては所管する有価証券について管理を、経営企画部においては総合的なリスク管理を行い、定期的に時価を把握しています。また、資産の自己査定及び償却・引当規程に従い、その状況について取締役会に報告しています。

なお、事業推進目的のために保有する当社が設定する投資信託等については、純資産額に対する保有制限を設けており、また、自社設定投信等の取得・処分に関する規則に従い、定期的に取締役会において報告し、投資家の資金性格、金額、および投資家数等の状況から検討した結果、目的が達成されたと判断した場合には速やかに処分することとしています。

また、特定金外信託を通じ保有している投資信託につきましては、市場価格の変動リスクについて為替予約、株価指数先物、債券先物、スワップ取引などのデリバティブ取引により一部リスクヘッジしております。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

当事業年度における貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、市場価格のないものは、次表には含まれておりません（（注1）参照）。また、現金及び預金、顧客分別金信託、未収委託者報酬、未収運用受託報酬、未収投資助言報酬、顧客からの預り金、未払金は、短期間で決済されるため時価が帳簿価格に近似することから、注記を省略しております。

前事業年度（2022年3月31日）

（単位：千円）

区分	貸借対照表計上額	時価	差額
(1)金銭の信託	-	-	-
(2)投資有価証券 その他有価証券	14,172,545	14,172,545	-
資産計	14,172,545	14,172,545	-

当事業年度（2023年3月31日）

（単位：千円）

区分	貸借対照表計上額	時価	差額
(1)金銭の信託	12,645,575	12,645,575	-
(2)投資有価証券 その他有価証券	9,182,466	9,182,466	-
資産計	21,828,042	21,828,042	-

(注1)市場価格のない金融商品の貸借対照表計上額

（単位：千円）

区分	前事業年度 (2022年3月31日)	当事業年度 (2023年3月31日)
その他有価証券 非上場株式	39,809	39,809
合計	39,809	39,809
子会社株式 非上場株式	11,246,398	11,850,598
合計	11,246,398	11,850,598

## 3. 金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項

金融商品の時価を、時価の算定に係るインプットの観察可能性及び重要性に応じて、以下の3つのレベルに分類しております。なお、時価算定会計基準適用指針27-3項に定める経過的な取扱いに従って、前事業年度に係る「金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項」については記載しておりません。

レベル1の時価：観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、活発な市場において形成される当該時価の算定の対象となる資産又は負債に関する相場価格により算定した時価

レベル2の時価：観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、レベル1のインプット以外の時価の算定に係るインプットを用いて算定した時価

レベル3の時価：観察できない時価の算定に係るインプットを使用して算定した時価

時価の算定に重要な影響を与えるインプットを複数使用している場合には、それらのインプットがそれぞれ属するレベルのうち、時価の算定における優先順位が最も低いレベルに時価を分類しております。

時価で貸借対照表に計上している金融商品

（単位：千円）

区分	時価			合計
	レベル1	レベル2	レベル3	
(1) 金銭の信託	-	12,645,575	-	12,645,575
(2) 投資有価証券 その他有価証券	-	9,182,466	-	9,182,466
資産計	-	21,828,042	-	21,828,042

時価の算定に用いた評価技法及び時価の算定に係るインプットの説明

## (1) 金銭の信託

信託財産は、主として投資信託、デリバティブ取引、その他の資産（コールローン・委託証拠金等）で構成されております。信託財産を構成する金融商品の時価について、投資信託は基準価額、デリバティブ取引は、取引相手先金融機関より提示された価格によっております。また、その他の資産については短期間で決済されるため、時価は帳簿価額とほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

## (2) 投資有価証券 その他有価証券

投資有価証券は、市場での取引頻度が低く、活発な市場における相場価格とは認められないため、公表されている基準価額又は取引金融機関から提示された価格により評価しております。

(有価証券関係)

## 1. 子会社株式

前事業年度（2022年3月31日）

子会社株式（貸借対照表計上額 関係会社株式11,246,398千円）は、市場価格がないことから、記載しておりません。

当事業年度（2023年3月31日）

子会社株式（貸借対照表計上額 関係会社株式11,850,598千円）は、市場価格がないことから、記載しておりません。

## 2. その他有価証券

前事業年度（2022年3月31日）

（単位：千円）

区分	貸借対照表計上額	取得原価	差額
(1) 貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの 投資信託等	9,299,062	8,672,725	626,337
小計	9,299,062	8,672,725	626,337
(2) 貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの 投資信託等	4,873,482	5,039,817	166,335
小計	4,873,482	5,039,817	166,335

合計	14,172,545	13,712,543	460,001
----	------------	------------	---------

(注) 非上場株式等(貸借対照表計上額 39,809千円)については、市場価格がないことから、記載しておりません。

当事業年度(2023年3月31日)

(単位:千円)

区分	貸借対照表計上額	取得原価	差額
(1)貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの 投資信託等	3,144,004	3,054,367	89,637
小計	3,144,004	3,054,367	89,637
(2)貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの 投資信託等	6,038,462	6,295,278	256,815
小計	6,038,462	6,295,278	256,815
合計	9,182,466	9,349,645	167,178

(注) 非上場株式等(貸借対照表計上額 39,809千円)については、市場価格がないことから、記載しておりません。

### 3. 事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

(単位:千円)

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
4,082,976	911,268	81,384

(単位:千円)

償還額	償還益の合計額	償還損の合計額
7,183,410	383,608	146,219

当事業年度(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

(単位:千円)

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
1,675,637	25,848	152,691

(単位:千円)

償還額	償還益の合計額	償還損の合計額
6,449,143	119,033	83,598

(退職給付関係)

#### 1. 採用している退職給付制度の概要

当社は、確定給付型の制度として、退職一時金制度を設けております。また、確定拠出型の制度として、確定拠出年金制度を設けております。

#### 2. 確定給付制度

##### (1)退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

(単位:千円)

	前事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
退職給付債務の期首残高	5,258,448	5,084,506
勤務費用	454,611	429,188
利息費用	1,013	6,502
数理計算上の差異の発生額	34,553	12,781
退職給付の支払額	595,013	479,583
過去勤務費用の発生額	-	-
退職給付債務の期末残高	5,084,506	5,027,832

##### (2)退職給付債務の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金の調整表

(単位:千円)

	前事業年度 (2022年3月31日)	当事業年度 (2023年3月31日)
非積立型制度の退職給付債務	5,084,506	5,027,832
未認識数理計算上の差異	-	-
未認識過去勤務費用	-	-
退職給付引当金	5,084,506	5,027,832

##### (3)退職給付費用及びその内訳項目の金額

	前事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
勤務費用	454,611	429,188
利息費用	1,013	6,502
数理計算上の差異の費用処理額	34,553	12,781
その他	211,487	201,641
確定給付制度に係る退職給付費用	632,559	624,551

(注) その他は、その他の関係会社等からの出向者の年金掛金負担分及び退職給付引当額相当額負担分、退職定年制度適用による割増退職金並びに確定拠出年金への拠出額であります。

#### (4)数理計算上の計算基礎に関する事項

主要な数理計算上の計算基礎（加重平均で表わしております。）

	前事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
割引率	0.130%	0.230%

### 3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度237,296千円、当事業年度241,556千円であります。

#### (税効果会計関係)

##### 1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

	(単位：千円)	
	前事業年度 (2022年3月31日)	当事業年度 (2023年3月31日)
繰延税金資産		
退職給付引当金	1,556,876	1,539,522
賞与引当金	643,119	551,617
調査費	279,809	473,972
未払金	284,070	211,439
未払事業税	139,522	39,995
ソフトウェア償却	107,998	105,506
子会社株式評価損	114,876	114,876
その他有価証券評価差額金	93,946	120,350
その他	28,056	21,158
繰延税金資産小計	3,248,274	3,178,439
評価性引当額	189,102	193,662
繰延税金資産合計	3,059,171	2,984,776
繰延税金負債		
無形固定資産	4,151,648	3,504,563
資産除去債務	825	3,201
その他有価証券評価差額金	186,107	27,506
繰延税金負債合計	4,338,581	3,535,270
繰延税金資産（負債）の純額	1,279,409	550,493

##### 2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳

	前事業年度 (2022年3月31日)	当事業年度 (2023年3月31日)
法定実効税率	30.6%	30.6%
(調整)		
交際費等永久に損金に算入されない項目	1.6	3.0
のれん償却費	1.4	2.9
所得税額控除による税額控除	-	1.3

その他	0.3	1.2
税効果会計適用後の法人税等の負担率	34.1	34.0

## (収益認識関係)

顧客との契約から生じる収益を分解した情報は、「セグメント情報等」注記に記載のとおりであります。

## (セグメント情報等)

前事業年度(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

## 1.セグメント情報

当社は、投資運用業及び投資助言業などの金融商品取引業を中心とする営業活動を展開しております。これらの営業活動は、金融その他の役務提供を伴っており、この役務提供と一体となった営業活動を基に収益を得ております。

従って、当社の事業区分は、「投資・金融サービス業」という単一の事業セグメントに属しており、事業の種類別セグメント情報の記載を省略しております。

## 2.関連情報

## (1)製品及びサービスごとの情報

(単位：千円)

	委託者報酬	運用受託報酬	投資助言報酬	その他	合計
外部顧客への営業収益	66,139,024	9,652,634	1,256,334	231,982	77,279,976

## (2)地域ごとの情報

## 営業収益

本邦の外部顧客への営業収益に区分した金額が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、地域ごとの営業収益の記載を省略しております。

## 有形固定資産

本邦に所在している有形固定資産の金額が貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えるため、地域ごとの有形固定資産の記載を省略しております。

## (3)主要な顧客ごとの情報

外部顧客への営業収益のうち、損益計算書の営業収益の10%以上を占める相手先がないため、記載はありません。

## 3.報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

当社は、投資・金融サービス業の単一セグメントであり、記載を省略しております。

## 4.報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

当社は、投資・金融サービス業の単一セグメントであり、記載を省略しております。

## 5.報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

当事業年度(自 2022年4月1日 至2023年3月31日)

## 1.セグメント情報

当社は、投資運用業及び投資助言業などの金融商品取引業を中心とする営業活動を展開しております。これらの営業活動は、金融その他の役務提供を伴っており、この役務提供と一体となった営業活動を基に収益を得ております。

従って、当社の事業区分は、「投資・金融サービス業」という単一の事業セグメントに属しており、事業の種類別セグメント情報の記載を省略しております。

## 2.関連情報

## (1)製品及びサービスごとの情報

(単位：千円)

	委託者報酬	運用受託報酬	投資助言報酬	その他	合計
外部顧客への営業収益	61,471,271	8,978,419	1,273,386	231,218	71,954,296

## (2)地域ごとの情報

## 営業収益

本邦の外部顧客への営業収益に区分した金額が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、地域ごとの営業収益の記載を省略しております。

## 有形固定資産

本邦に所在している有形固定資産の金額が貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えるため、地域ごとの有形固定資産の記載を省略しております。

## (3) 主要な顧客ごとの情報

外部顧客への営業収益のうち、損益計算書の営業収益の10%以上を占める相手先がないため、記載はありません。

## 3. 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

当社は、投資・金融サービス業の単一セグメントであり、記載を省略しております。

## 4. 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

当社は、投資・金融サービス業の単一セグメントであり、記載を省略しております。

## 5. 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

## (関連当事者情報)

前事業年度(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

## 1. 関連当事者との取引

## (1) 兄弟会社等

(単位：千円)

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金、出資金又は基金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額	科目	期末残高
親会社の 子会社	(株)三井住友銀行	東京都千代田区	1,770,996,505	銀行業	-	% 投信の販売委託 役員の兼任	委託販売 手数料	4,727,024	未払 手数料	1,098,966
親会社の 子会社	SMBC日興証券(株)	東京都千代田区	10,000,000	証券業	-	% 投信の販売委託 役員の兼任	委託販売 手数料	8,397,864	未払 手数料	1,661,614

## (注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

投信の販売委託については、一般取引条件を基に、協議の上決定しております。

## 2. 親会社に関する注記

株式会社三井住友フィナンシャルグループ（東京証券取引所、名古屋証券取引所、ニューヨーク証券取引所に上場）

当事業年度(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

## 1. 関連当事者との取引

## (1) 兄弟会社等

(単位：千円)

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金、出資金又は基金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額	科目	期末残高
親会社の 子会社	(株)三井住友銀行	東京都千代田区	1,770,996,505	銀行業	-	% 投信の販売委託 役員の兼任	委託販売 手数料	5,279,199	未払 手数料	1,265,651
親会社の 子会社	SMBC日興証券(株)	東京都千代田区	10,000,000	証券業	-	% 投信の販売委託 役員の兼任	委託販売 手数料	7,030,381	未払 手数料	1,288,749

## (注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

投信の販売委託については、一般取引条件を基に、協議の上決定しております。

## 2. 親会社に関する注記

株式会社三井住友フィナンシャルグループ（東京証券取引所、名古屋証券取引所、ニューヨーク証券取引所に上場）

## (1株当たり情報)

	前事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
1株当たり純資産額	2,613.28円	2,587.21円
1株当たり当期純利益	121.61円	61.91円

(注) 1. 潜在株式調整後1株当たり当期純利益については、潜在株式が存在しないため記載していません。

2. 1株当たり当期純利益の算定上の基礎は、次のとおりであります。

	前事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
1株当たり当期純利益		
当期純利益(千円)	4,119,040	2,097,028
普通株主に帰属しない金額(千円)	-	-
普通株式に係る当期純利益(千円)	4,119,040	2,097,028
期中平均株式数(株)	33,870,060	33,870,060

## 中間財務諸表

### (1) 中間貸借対照表

(単位：千円)

第39期中間会計期間 (2023年9月30日)	
<b>資産の部</b>	
<b>流動資産</b>	
現金及び預金	71,777,366
金銭の信託	12,836,073
顧客分別金信託	300,049
前払費用	544,624
未収委託者報酬	13,133,566
未収運用受託報酬	2,879,922
未収投資助言報酬	463,644
未収収益	67,881
その他	193,812
流動資産合計	102,196,941
<b>固定資産</b>	
有形固定資産	1 1,897,269
<b>無形固定資産</b>	
のれん	2,893,139
顧客関連資産	10,388,702
その他	2,893,330
無形固定資産合計	16,175,172
<b>投資その他の資産</b>	
投資有価証券	9,623,355
関係会社株式	1,927,221
繰延税金資産	128,142
その他	1,543,634
貸倒引当金	20,750
投資その他の資産合計	13,201,604
固定資産合計	31,274,046
資産合計	133,470,988
<b>負債の部</b>	
<b>流動負債</b>	
リース債務	2,070
顧客からの預り金	11,882
その他の預り金	161,963
未払金	6,019,407
未払費用	6,744,050
未払法人税等	3,908,872
前受収益	21,118

賞与引当金		2,110,575
資産除去債務		13,940
その他	2	623,468
流動負債合計		19,617,350
固定負債		
リース債務		1,172
退職給付引当金		5,235,679
固定負債合計		5,236,852
負債合計		24,854,202
純資産の部		
株主資本		
資本金		2,000,000
資本剰余金		
資本準備金		8,628,984
その他資本剰余金		73,466,962
資本剰余金合計		82,095,946
利益剰余金		
利益準備金		284,245
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金		24,226,602
利益剰余金合計		24,510,847
株主資本合計		108,606,793
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		9,992
評価・換算差額等合計		9,992
純資産合計		108,616,786
負債純資産合計		133,470,988

## (2) 中間損益計算書

(単位：千円)

		第39期中間会計期間 (自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)
営業収益		
委託者報酬		33,390,366
運用受託報酬		4,611,539
投資助言報酬		646,058
その他の営業収益		137,072
営業収益計		38,785,036
営業費用		26,393,207
一般管理費	1	10,162,729
営業利益		2,229,099
営業外収益	2	11,280,120
営業外費用	3	51,894
経常利益		13,457,325
特別利益	4	14,096,622
特別損失	5	358
税引前中間純利益		27,553,589
法人税、住民税及び事業税		5,843,255
法人税等調整額		716,591
法人税等合計		5,126,663



中間純利益

22,426,926

## (3)中間株主資本等変動計算書

第39期中間会計期間（自 2023年4月1日 至 2023年9月30日）

（単位：千円）

	株主資本					
	資本金	資本剰余金			利益剰余金	
		資本準備金	その他資本 剰余金	資本剰余金 合計	利益 準備金	その他利益剰余金 繰越利益 剰余金
当期首残高	2,000,000	8,628,984	73,466,962	82,095,946	284,245	3,391,568
当中間期変動額						
剰余金の配当						1,591,892
中間純利益						22,426,926
株主資本以外の 項目の当中間期 変動額（純額）						
当中間期変動額合計	-	-	-	-	-	20,835,033
当中間期末残高	2,000,000	8,628,984	73,466,962	82,095,946	284,245	24,226,602

	株主資本		評価・換算差額等		純資産合計
	利益剰余金	株主資本合計	その他有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
	利益剰余金 合計				
当期首残高	3,675,814	87,771,760	142,558	142,558	87,629,201
当中間期変動額					
剰余金の配当	1,591,892	1,591,892			1,591,892
中間純利益	22,426,926	22,426,926			22,426,926
株主資本以外の 項目の当中間期 変動額（純額）			152,551	152,551	152,551
当中間期変動額合計	20,835,033	20,835,033	152,551	152,551	20,987,584
当中間期末残高	24,510,847	108,606,793	9,992	9,992	108,616,786

## 注記事項

## (重要な会計方針)

## 1. 資産の評価基準及び評価方法

## (1)有価証券

## 子会社株式

移動平均法による原価法

## その他有価証券

市場価格のない株式等以外

中間会計期間末日の市場価格等に基づく時価法

（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定）

市場価格のない株式等

移動平均法による原価法

## (2)金銭の信託

運用目的の金銭の信託

時価法

## 2. 固定資産の減価償却の方法

## (1)有形固定資産（リース資産を除く）

定率法によっております。但し、建物（建物附属設備を除く）並びに2016年4月1日以降に取得した建物附属設備については、定額法によっております。

なお、主な耐用年数は次のとおりであります。

建物	8～50年
器具備品	4～15年

## (2)無形固定資産（リース資産を除く）

定額法によっております。

なお、主な償却年数は次のとおりであります。

のれん	14年
顧客関連資産	6～19年
ソフトウェア（自社利用分）	5年

## (3)リース資産

所有権移転外ファイナンス・リース取引に係るリース資産

リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法を採用しております。

## 3. 引当金の計上基準

## (1)貸倒引当金

債権の貸倒れによる損失に備えるため一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権等の特定の債権については個別に回収可能性を検討し、回収不能見込額を計上しております。

## (2)賞与引当金

従業員賞与の支給に充てるため、将来の支給見込額のうち当中間会計期間の負担額を計上しております。

## (3)退職給付引当金

従業員の退職金支給に備えるため、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき、当中間会計期間において発生していると認められる額を計上しております。

退職給付見込額の期間帰属方法

退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当中間会計期間末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。

数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法

過去勤務費用については、その発生時において一時に費用処理しております。

数理計算上の差異については、その発生時において一時に費用処理しております。

## 4. 収益及び費用の計上基準

当社の顧客との契約から生じる収益に関する主要な事業における主な履行義務の内容及び収益を認識する通常の時点は以下のとおりであります。

## (1)委託者報酬

委託者報酬は、投資信託の信託約款に基づき日々の純資産額に対する一定割合として認識され、確定した報酬を受け取ります。当該報酬は投資信託の運用期間にわたり収益として認識しております。

## (2)運用受託報酬

運用受託報酬は、対象顧客との投資一任契約に基づき、主に契約期間内の月末純資産平均価額に対する一定割合として認識され、確定した報酬を受け取ります。当該報酬は対象口座の運用期間にわたり収益として認識しております。

## (3)投資助言報酬

投資助言報酬は、対象顧客との投資助言契約に基づき、主に契約期間内の月末純資産平均価額に対する一定割合として認識され、確定した報酬を受け取ります。当該報酬は対象口座の助言期間にわたり収益として認識しております。

## (中間貸借対照表関係)

第39期中間会計期間 (2023年9月30日)	
1.有形固定資産の減価償却累計額	1,963,152千円
2.消費税等の取扱い	
仮払消費税等及び仮受消費税等は、相殺のうえ、金額的重要性が乏しいため、流動負債のその他に含めて表示しております。	

3. 当社は、運転資金の効率的な調達を行うため取引銀行1行と当座借越契約を締結しております。

当中間会計期間末における当座借越契約に係る借入金未実行残高等は次のとおりであります。

当座借越極度額の総額	10,000,000千円
借入実行残高	-
差引額	10,000,000千円

（中間損益計算書関係）

第39期中間会計期間 （自 2023年4月1日 至 2023年9月30日）	
1. 一般管理費のうち主要なもの	
のれん償却費	152,270千円
減価償却実施額	
有形固定資産	155,138千円
無形固定資産	1,475,775千円
2. 営業外収益のうち主要なもの	
受取配当金	11,020,394千円
投資有価証券売却益	2,513千円
金銭の信託運用益	190,497千円
3. 営業外費用のうち主要なもの	
為替差損	1,978千円
投資有価証券償還損	883千円
投資有価証券売却損	48,575千円
4. 特別利益のうち主要なもの	
子会社株式売却益	14,096,622千円
5. 特別損失のうち主要なもの	
固定資産除却損	358千円

（中間株主資本等変動計算書関係）

第39期中間会計期間（自 2023年4月1日 至 2023年9月30日）

1. 発行済株式数に関する事項

	当事業年度期首 株式数	当中間会計期間 増加株式数	当中間会計期間 減少株式数	当中間会計期間末 株式数
普通株式	33,870,060株	-	-	33,870,060株

2. 剰余金の配当に関する事項

決議	株式の種類	配当金の総額 (千円)	一株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
2023年6月28日 定時株主総会	普通株式	1,591,892	47.00	2023年 3月31日	2023年 6月29日

（リース取引関係）

第39期中間会計期間 （自 2023年4月1日 至 2023年9月30日）	
1. オペレーティング・リース取引 （借主側）	
未経過リース料（解約不能のもの）	
1年以内	1,161,545千円
1年超	580,772千円
合計	1,742,317千円

（金融商品関係）

1. 金融商品の時価等に関する事項

第39期中間会計期間（2023年9月30日）

2023年9月30日における中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、市場価格のないものは、次表には含まれておりません（（注1）参照）。また、現金及び預金、顧客分別金信託、未収委託者報酬、未収運用受託報酬、未収投資助言報酬、顧客からの預り金、未払金は、短期間で決済されるため時価が帳簿価格に近似することから、注記を省略しております。

（単位：千円）

区分	中間貸借対照表計上額	時価	差額
(1)金銭の信託	12,836,073	12,836,073	-
(2)投資有価証券 その他有価証券	9,582,998	9,582,998	-
資産計	22,419,071	22,419,071	-

(注1) 市場価格のない金融商品

(単位：千円)

区分	中間貸借対照表計上額
その他有価証券 非上場株式	40,356
合計	40,356
子会社株式 非上場株式	1,927,221
合計	1,927,221

これらについては、「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号2020年3月31日）第5項に従い、1. 金融商品の時価等に関する事項及び2. 金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項で開示している表中には含めておりません。

## 2. 金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項

金融商品の時価を、時価の算定に係るインプットの観察可能性及び重要性に応じて、以下の3つのレベルに分類しております。

レベル1の時価：観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、活発な市場において形成される当該時価の算定の対象となる資産又は負債に関する相場価格により算定した時価

レベル2の時価：観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、レベル1のインプット以外の時価の算定に係るインプットを用いて算定した時価

レベル3の時価：観察できない時価の算定に係るインプットを使用して算定した時価

時価の算定に重要な影響を与えるインプットを複数使用している場合には、それらのインプットがそれぞれ属するレベルのうち、時価の算定における優先順位が最も低いレベルに時価を分類しております。

時価で中間貸借対照表に計上している金融商品

(単位：千円)

区分	時価			合計
	レベル1	レベル2	レベル3	
(1)金銭の信託	-	12,836,073	-	12,836,073
(2)投資有価証券 その他有価証券	-	9,582,998	-	9,582,998
資産計	-	22,419,071	-	22,419,071

(注1) 時価の算定に用いた評価技法及び時価の算定に係るインプットの説明

### (1) 金銭の信託

信託財産は、主として投資信託、デリバティブ取引、その他の資産（コールローン・委託証拠金等）で構成されております。信託財産を構成する金融商品の時価について、投資信託は基準価額、デリバティブ取引は、取引相手先金融機関より提示された価格によっております。また、その他の資産については短期間で決済されるため、時価は帳簿価額とほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

### (2) 投資有価証券 その他有価証券

投資有価証券は、市場での取引頻度が低く、活発な市場における相場価格とは認められないため、公表されている基準価額又は取引金融機関から提示された価格により評価しております。

(有価証券関係)

第39期中間会計期間（2023年9月30日）

#### 1. 子会社株式

子会社株式（中間貸借対照表計上額 1,927,221千円）は、市場価格がないことから、記載していません。

#### 2. その他有価証券

(単位：千円)

区分	中間貸借対照表計上額	取得原価	差額
(1)中間貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの 投資信託等	3,341,749	3,156,408	185,340
小計	3,341,749	3,156,408	185,340

(2)中間貸借対照表計上額が取得原価を 超えないもの 投資信託等	6,241,249	6,403,283	162,034
小計	6,241,249	6,403,283	162,034
合計	9,582,998	9,559,692	23,306

(注)非上場株式等（中間貸借対照表計上額 40,356千円）については、市場価格がないことから、記載しておりません。

(デリバティブ取引関係)

当社は、デリバティブ取引を全く行っておりませんので、該当事項はありません。

(収益認識関係)

第39期中間会計期間（自 2023年4月1日 至 2023年9月30日）

顧客との契約から生じる収益を分解した情報は、「セグメント情報等」注記に記載のとおりであります。

(セグメント情報等)

第39期中間会計期間（自 2023年4月1日 至 2023年9月30日）

1. セグメント情報

当社は、投資運用業及び投資助言業などの金融商品取引業を中心とする営業活動を展開しております。これらの営業活動は、金融その他の役務提供を伴っており、この役務提供と一体となった営業活動を基に収益を得ております。

従って、当社の事業区分は、「投資・金融サービス業」という単一の事業セグメントに属しており、事業の種類別セグメント情報の記載を省略しております。

2. 関連情報

(1)製品及びサービスごとの情報

(単位：千円)

	委託者報酬	運用受託報酬	投資助言報酬	その他	合計
外部顧客への 営業収益	33,390,366	4,611,539	646,058	137,072	38,785,036

(2)地域ごとの情報

営業収益

本邦の外部顧客への営業収益に区分した金額が中間損益計算書の営業収益の90%を超えるため、地域ごとの営業収益の記載を省略しております。

有形固定資産

本邦に所在している有形固定資産の金額が中間貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えるため、地域ごとの有形固定資産の記載を省略しております。

(3)主要な顧客ごとの情報

外部顧客への営業収益のうち、中間損益計算書の営業収益の10%以上を占める相手先がないため、記載はありません。

3. 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

該当事項はありません。

4. 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

当社は、投資・金融サービス業の単一セグメントであり、記載を省略しております。

5. 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

(1株当たり情報)

第39期中間会計期間 (自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)	
1株当たり純資産額	3,206円86銭
1株当たり中間純利益	662円14銭
なお、潜在株式調整後1株当たり中間純利益については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。	

#### 4【利害関係人との取引制限】

委託会社は、「金融商品取引法」の定めるところにより、利害関係人との取引について、次に掲げる行為が禁止されています。

- イ 自己またはその取締役もしくは執行役との間における取引を行うことを内容とした運用を行うこと(投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)
- ロ 運用財産相互間において取引を行うことを内容とした運用を行うこと(投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)
- ハ 通常の取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等(委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。)または子法人等(委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。)と有価証券の売買その他の取引または店頭デリバティブ取引を行うこと。
- ニ 委託会社の親法人等または子法人等の利益を図るため、その行う投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額もしくは市場の状況に照らして不必要な取引を行うことを内容とした運用を行うこと。
- ホ 上記ハ、ニに掲げるもののほか、委託会社の親法人等または子法人等が関与する行為であって、投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為。

#### 5【その他】

- イ 定款の変更、その他の重要事項
  - (イ) 定款の変更  
該当ありません。
  - (ロ) その他の重要事項  
該当ありません。
- ロ 訴訟事件その他会社に重要な影響を与えることが予想される事実  
該当ありません。

#### 第2【その他の関係法人の概況】

##### 1【名称、資本金の額及び事業の内容】

###### イ 受託会社

- (イ) 名称 三井住友信託銀行株式会社
- (ロ) 資本金の額 342,037百万円(2023年3月末現在)
- (ハ) 事業の内容 銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

###### 〔参考情報：再信託受託会社の概要〕

- ・ 名称 株式会社日本カストディ銀行
- ・ 資本金の額 51,000百万円(2023年3月末現在)
- ・ 事業の内容 銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

## □ 販売会社

名称	資本金の額（百万円） 2023年3月末現在	事業の内容
S M B C 日興証券株式会社	10,000	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

## 2【関係業務の概要】

### イ 受託会社

信託契約の受託会社であり、信託財産の保管・管理・計算等を行います。

### □ 販売会社

委託会社との間で締結された販売契約に基づき、日本における当ファンドの募集・販売の取扱い、投資信託説明書（目論見書）の提供、一部解約の実行の請求の受け付け、収益分配金、償還金の支払事務等を行います。

## 3【資本関係】

（持株比率5%以上を記載しています。）

該当事項はありません。

## 第3【その他】

### 1 目論見書の表紙から本文の前までおよび裏表紙の記載について

- (1) 「金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書である。」旨を記載することがあります。
- (2) 委託会社の金融商品取引業者登録番号を記載することがあります。
- (3) 委託会社のホームページのアドレスおよび他のインターネットのアドレス（これらのアドレスをコード化した図形等も含む）を記載することがあります。
- (4) 請求目論見書の入手方法および投資信託約款が請求目論見書に掲載されている旨を記載することがあります。
- (5) 目論見書の使用開始日を記載することがあります。
- (6) 投資信託の財産は受託会社において信託法に基づき分別管理されている旨を記載することがあります。
- (7) 請求目論見書は投資者の請求により販売会社から交付される旨および当該請求を行った場合にはその旨の記録をしておくべきである旨を記載することがあります。
- (8) 「ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。」との趣旨を示す記載をすることがあります。
- (9) 当ファンドのロゴおよび委託会社のロゴを記載することがあります。
- (10) ファンドの形態および属性、申込みにかかる事項、ユニバーサルデザインフォントマークを記載することがあります。
- (11) 写真、イラスト、図案およびキャッチコピーを採用することがあります。また、ファンドの管理番号等を記載することがあります。

### 2 目論見書は電子媒体等として使用される他、インターネット等に掲載されることがあります。

### 3 当ファンドの投資信託約款の全文を請求目論見書に掲載することがあります。

### 4 目論見書は、目論見書の別称として「投資信託説明書（交付目論見書）」または「投資信託説明書（請求目論見書）」と称して使用することがあります。

### 5 評価機関等から当ファンドに対する評価を取得し、使用することがあります。

### 6 有価証券届出書を個別に提出している複数のファンドの実質的な投資対象資産に共通性がある場合には、当該複数のファンドを一つの投資信託説明書（交付目論見書）で説明することがあります。また、有価証券届出書を個別に提出している複数のファンドにかかる投資信託説明書（交付目論見書）および投資信託説明書（請求目論見書）を一体のものとして使用することがあります。

**独立監査人の監査報告書**

2023年6月15日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 菅野 雅子指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 佐藤 栄裕**監査意見**

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友DSアセットマネジメント株式会社の2022年4月1日から2023年3月31日までの第38期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友DSアセットマネジメント株式会社の2023年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

**監査意見の根拠**

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、会社から独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

**その他の記載内容**

その他の記載内容は、監査した財務諸表を含む開示書類に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。

当監査法人は、その他の記載内容が存在しないと判断したため、その他の記載内容に対するいかなる作業も実施していない。

**財務諸表に対する経営者並びに監査役及び監査役会の責任**

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

監査役及び監査役会の責任は、財務報告プロセスの整備及び運用における取締役の職務の執行を監視することにある。

**財務諸表監査における監査人の責任**

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。



- ・財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、監査役及び監査役会に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

#### 利害関係

会社と当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

- 
- (注) 1. 上記の監査報告書の原本は当社(有価証券報告書提出会社)が別途保管しております。  
2. X B R Lデータは監査の対象には含まれていません。

## 独立監査人の監査報告書

2024年2月14日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

PwC Japan有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員  
業務執行社員

公認会計士 山口 健志

指定有限責任社員  
業務執行社員

公認会計士 榊原 康太

## 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友DS・TOPIXインデックス・ファンドの2022年12月1日から2023年11月30日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友DS・TOPIXインデックス・ファンドの2023年11月30日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、三井住友DSアセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

## その他の事項

ファンドの2022年11月30日をもって終了した前計算期間の財務諸表は、前任監査人によって監査されている。前任監査人は、当該財務諸表に対して2023年2月7日付けで無限定適正意見を表明している。

## その他の記載内容

その他の記載内容は、有価証券報告書及び有価証券届出書（訂正有価証券届出書を含む。）に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。経営者の責任は、その他の記載内容を作成し開示することにある。

当監査法人の財務諸表に対する監査意見の対象にはその他の記載内容は含まれておらず、当監査法人はその他の記載内容に対して意見を表明するものではない。

財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうか検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。

当監査法人は、実施した作業に基づき、その他の記載内容に重要な誤りがあると判断した場合には、その事実を報告することが求められている。

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

## 財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業的前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

## 財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与

えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・ 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・ 財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、経営者に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

#### 利害関係

三井住友DSアセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

- (注) 1. 上記の監査報告書の原本は当社（有価証券報告書提出会社）が別途保管しております。  
2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

## 独立監査人の監査報告書

2024年2月14日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

PwC Japan有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員  
業務執行社員

公認会計士 山口 健志

指定有限責任社員  
業務執行社員

公認会計士 榊原 康太

## 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友DS・日経225インデックス・ファンドの2022年12月1日から2023年11月30日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友DS・日経225インデックス・ファンドの2023年11月30日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、三井住友DSアセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

## その他の事項

ファンドの2022年11月30日をもって終了した前計算期間の財務諸表は、前任監査人によって監査されている。前任監査人は、当該財務諸表に対して2023年2月7日付けで無限定適正意見を表明している。

## その他の記載内容

その他の記載内容は、有価証券報告書及び有価証券届出書（訂正有価証券届出書を含む。）に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。経営者の責任は、その他の記載内容を作成し開示することにある。

当監査法人の財務諸表に対する監査意見の対象にはその他の記載内容は含まれておらず、当監査法人はその他の記載内容に対して意見を表明するものではない。

財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうかを検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。

当監査法人は、実施した作業に基づき、その他の記載内容に重要な誤りがあると判断した場合には、その事実を報告することが求められている。

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

## 財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業的前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

## 財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与

えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・ 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・ 財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、経営者に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

#### 利害関係

三井住友DSアセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

- (注) 1. 上記の監査報告書の原本は当社（有価証券報告書提出会社）が別途保管しております。  
2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

## 独立監査人の監査報告書

2024年2月14日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

PwC Japan有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員  
業務執行社員

公認会計士 山口 健志

指定有限責任社員  
業務執行社員

公認会計士 榊原 康太

## 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友DS・先進国株式インデックス・ファンドの2022年12月1日から2023年11月30日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友DS・先進国株式インデックス・ファンドの2023年11月30日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、三井住友DSアセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

## その他の事項

ファンドの2022年11月30日をもって終了した前計算期間の財務諸表は、前任監査人によって監査されている。前任監査人は、当該財務諸表に対して2023年2月7日付けで無限定適正意見を表明している。

## その他の記載内容

その他の記載内容は、有価証券報告書及び有価証券届出書（訂正有価証券届出書を含む。）に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。経営者の責任は、その他の記載内容を作成し開示することにある。

当監査法人の財務諸表に対する監査意見の対象にはその他の記載内容は含まれておらず、当監査法人はその他の記載内容に対して意見を表明するものではない。

財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうか検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。

当監査法人は、実施した作業に基づき、その他の記載内容に重要な誤りがあると判断した場合には、その事実を報告することが求められている。

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

## 財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業的前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

## 財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与

えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・ 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・ 財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、経営者に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

#### 利害関係

三井住友DSアセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

- (注) 1. 上記の監査報告書の原本は当社（有価証券報告書提出会社）が別途保管しております。  
2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

## 独立監査人の監査報告書

2024年2月14日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

PwC Japan有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員  
業務執行社員

公認会計士 山口 健志

指定有限責任社員  
業務執行社員

公認会計士 榊原 康太

## 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友DS・新興国株式インデックス・ファンドの2022年12月1日から2023年11月30日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友DS・新興国株式インデックス・ファンドの2023年11月30日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、三井住友DSアセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

## その他の事項

ファンドの2022年11月30日をもって終了した前計算期間の財務諸表は、前任監査人によって監査されている。前任監査人は、当該財務諸表に対して2023年2月7日付けで無限定適正意見を表明している。

## その他の記載内容

その他の記載内容は、有価証券報告書及び有価証券届出書（訂正有価証券届出書を含む。）に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。経営者の責任は、その他の記載内容を作成し開示することにある。

当監査法人の財務諸表に対する監査意見の対象にはその他の記載内容は含まれておらず、当監査法人はその他の記載内容に対して意見を表明するものではない。

財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうかを検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。

当監査法人は、実施した作業に基づき、その他の記載内容に重要な誤りがあると判断した場合には、その事実を報告することが求められている。

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

## 財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業的前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

## 財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与



えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・ 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・ 財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、経営者に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

#### 利害関係

三井住友DSアセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

- (注) 1. 上記の監査報告書の原本は当社（有価証券報告書提出会社）が別途保管しております。  
2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

## 独立監査人の監査報告書

2024年2月14日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

PwC Japan有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員  
業務執行社員

公認会計士 山口 健志

指定有限責任社員  
業務執行社員

公認会計士 榊原 康太

## 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友DS・先進国債インデックス・ファンドの2022年12月1日から2023年11月30日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友DS・先進国債インデックス・ファンドの2023年11月30日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、三井住友DSアセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

## その他の事項

ファンドの2022年11月30日をもって終了した前計算期間の財務諸表は、前任監査人によって監査されている。前任監査人は、当該財務諸表に対して2023年2月7日付けで無限定適正意見を表明している。

## その他の記載内容

その他の記載内容は、有価証券報告書及び有価証券届出書（訂正有価証券届出書を含む。）に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。経営者の責任は、その他の記載内容を作成し開示することにある。

当監査法人の財務諸表に対する監査意見の対象にはその他の記載内容は含まれておらず、当監査法人はその他の記載内容に対して意見を表明するものではない。

財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうかを検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。

当監査法人は、実施した作業に基づき、その他の記載内容に重要な誤りがあると判断した場合には、その事実を報告することが求められている。

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

## 財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業的前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

## 財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与

えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・ 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・ 財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、経営者に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

#### 利害関係

三井住友DSアセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

- (注) 1. 上記の監査報告書の原本は当社（有価証券報告書提出会社）が別途保管しております。  
2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

## 独立監査人の監査報告書

2024年2月14日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

PwC Japan有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員  
業務執行社員

公認会計士 山口 健志

指定有限責任社員  
業務執行社員

公認会計士 榊原 康太

## 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友DS・新興国債インデックス・ファンドの2022年12月1日から2023年11月30日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友DS・新興国債インデックス・ファンドの2023年11月30日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、三井住友DSアセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

## その他の事項

ファンドの2022年11月30日をもって終了した前計算期間の財務諸表は、前任監査人によって監査されている。前任監査人は、当該財務諸表に対して2023年2月7日付けで無限定適正意見を表明している。

## その他の記載内容

その他の記載内容は、有価証券報告書及び有価証券届出書（訂正有価証券届出書を含む。）に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。経営者の責任は、その他の記載内容を作成し開示することにある。

当監査法人の財務諸表に対する監査意見の対象にはその他の記載内容は含まれておらず、当監査法人はその他の記載内容に対して意見を表明するものではない。

財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうかを検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。

当監査法人は、実施した作業に基づき、その他の記載内容に重要な誤りがあると判断した場合には、その事実を報告することが求められている。

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

## 財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業を前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

## 財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与

えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・ 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・ 財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、経営者に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

#### 利害関係

三井住友DSアセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

- (注) 1. 上記の監査報告書の原本は当社（有価証券報告書提出会社）が別途保管しております。  
2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

## 独立監査人の監査報告書

2024年2月14日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

PwC Japan有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員  
業務執行社員

公認会計士 山口 健志

指定有限責任社員  
業務執行社員

公認会計士 榊原 康太

## 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友DS・国内リートインデックス・ファンドの2022年12月1日から2023年11月30日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友DS・国内リートインデックス・ファンドの2023年11月30日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、三井住友DSアセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

## その他の事項

ファンドの2022年11月30日をもって終了した前計算期間の財務諸表は、前任監査人によって監査されている。前任監査人は、当該財務諸表に対して2023年2月7日付けで無限定適正意見を表明している。

## その他の記載内容

その他の記載内容は、有価証券報告書及び有価証券届出書（訂正有価証券届出書を含む。）に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。経営者の責任は、その他の記載内容を作成し開示することにある。

当監査法人の財務諸表に対する監査意見の対象にはその他の記載内容は含まれておらず、当監査法人はその他の記載内容に対して意見を表明するものではない。

財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうか検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。

当監査法人は、実施した作業に基づき、その他の記載内容に重要な誤りがあると判断した場合には、その事実を報告することが求められている。

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

## 財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業的前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

## 財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与

えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・ 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・ 財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、経営者に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

#### 利害関係

三井住友DSアセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

- (注) 1. 上記の監査報告書の原本は当社（有価証券報告書提出会社）が別途保管しております。  
2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

## 独立監査人の監査報告書

2024年2月14日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

PwC Japan有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員  
業務執行社員

公認会計士 山口 健志

指定有限責任社員  
業務執行社員

公認会計士 榊原 康太

## 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友DS・先進国リートインデックス・ファンドの2022年12月1日から2023年11月30日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友DS・先進国リートインデックス・ファンドの2023年11月30日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、三井住友DSアセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

## その他の事項

ファンドの2022年11月30日をもって終了した前計算期間の財務諸表は、前任監査人によって監査されている。前任監査人は、当該財務諸表に対して2023年2月7日付けで無限定適正意見を表明している。

## その他の記載内容

その他の記載内容は、有価証券報告書及び有価証券届出書（訂正有価証券届出書を含む。）に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。経営者の責任は、その他の記載内容を作成し開示することにある。

当監査法人の財務諸表に対する監査意見の対象にはその他の記載内容は含まれておらず、当監査法人はその他の記載内容に対して意見を表明するものではない。

財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうかを検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。

当監査法人は、実施した作業に基づき、その他の記載内容に重要な誤りがあると判断した場合には、その事実を報告することが求められている。

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

## 財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業的前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

## 財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与



えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・ 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・ 財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、経営者に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

#### 利害関係

三井住友DSアセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

- (注) 1. 上記の監査報告書の原本は当社（有価証券報告書提出会社）が別途保管しております。  
2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

## 独立監査人の監査報告書

2024年2月14日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

PwC Japan有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員  
業務執行社員

公認会計士 山口 健志

指定有限責任社員  
業務執行社員

公認会計士 榊原 康太

## 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友DS・ゴールドインデックス・ファンド（為替ヘッジあり）の2022年12月1日から2023年11月30日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友DS・ゴールドインデックス・ファンド（為替ヘッジあり）の2023年11月30日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、三井住友DSアセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

## その他の事項

ファンドの2022年11月30日をもって終了した前計算期間の財務諸表は、前任監査人によって監査されている。前任監査人は、当該財務諸表に対して2023年2月7日付けで無限定適正意見を表明している。

## その他の記載内容

その他の記載内容は、有価証券報告書及び有価証券届出書（訂正有価証券届出書を含む。）に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。経営者の責任は、その他の記載内容を作成し開示することにある。

当監査法人の財務諸表に対する監査意見の対象にはその他の記載内容は含まれておらず、当監査法人はその他の記載内容に対して意見を表明するものではない。

財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうかを検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。

当監査法人は、実施した作業に基づき、その他の記載内容に重要な誤りがあると判断した場合には、その事実を報告することが求められている。

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

## 財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業的前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

## 財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与

えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・ 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・ 財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、経営者に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

#### 利害関係

三井住友DSアセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

- (注) 1. 上記の監査報告書の原本は当社(有価証券報告書提出会社)が別途保管しております。  
2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

**独立監査人の中間監査報告書**

2023年11月17日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 佐藤 栄 裕指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 深井 康 治**中間監査意見**

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友DSアセットマネジメント株式会社の2023年4月1日から2024年3月31日までの第39期事業年度の中間会計期間（2023年4月1日から2023年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三井住友DSアセットマネジメント株式会社の2023年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（2023年4月1日から2023年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

**中間監査意見の根拠**

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準における当監査法人の責任は、「中間財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、会社から独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

**中間財務諸表に対する経営者並びに監査役及び監査役会の責任**

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

中間財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき中間財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

監査役及び監査役会の責任は、財務報告プロセスの整備及び運用における取締役の職務の執行を監視することにある。

**中間財務諸表監査における監査人の責任**

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得て、中間監査報告書において独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、中間財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に従って、中間監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- ・中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監

査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。

- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

監査人は、監査役及び監査役会に対して、計画した中間監査の範囲とその実施時期、中間監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む中間監査上の重要な発見事項、及び中間監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

#### 利害関係

会社と当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

---

(注) 1. 上記の中間監査報告書の原本は当社(有価証券報告書提出会社)が別途保管しております。

2. X B R Lデータは中間監査の対象には含まれていません。